

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年8月28日提出
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土田 雅央
【電話番号】	03-5405-0740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	継続募集額(平成30年8月29日から平成31年2月25日まで) 5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド
以下「当ファンド」といいます。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

*ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友アセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

当初元本は1口当たり1円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「DC積N日株」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

（５）【申込手数料】

無手数料です。

（６）【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社または前記「(4)発行(売出)価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

2018年8月29日から2019年2月25日まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8)【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。なお、委託会社においても申込みを取り扱いますので、委託会社は販売会社としての役割も有します。

販売会社の詳細につきましては、前記「(4)発行(売出)価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

(9)【払込期日】

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の基準価額×申込口数)を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10)【払込取扱場所】

販売会社において払込みを取り扱います。(販売会社は前記「(4)発行(売出)価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。)

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

イ 申込証拠金
ありません。

ロ 日本以外の地域における募集
ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用
ありません。

ニ 振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則に従って取り扱われるものとし、ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および当該振替機関の業務規程その他の規則に従って支払われます。

(参考：投資信託振替制度)

- ・ ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への記載・記録によって行われます。
- ・ 受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます(原則として受益証券を保有することはできません。)
- ・ ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・ 振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ロ TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとして運用を行います。
詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、金1,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

（イ）当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 （収益の源泉）	株式	目論見書または信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

（ロ）当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（株式一般））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載していません。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式であり、ファンドの収益は株式市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「株式」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	日本	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。

対象インデックス	TOPIX	目論見書または信託約款において、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
----------	-------	--

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
		不動産投信	
追加型	内外	その他資産 () 資産複合	特殊型

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般				
大型株	年2回	日本		日経225
中小型株	年4回	北米		
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回(隔月)	欧州		
公債				
社債	年12回(毎月)	アジア		
その他債券				
クレジット属性 ()	日々	オセアニア		TOPIX
	その他	中南米		
不動産投信	()	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	
その他資産 (投資信託証券(株式一般))		中近東(中東)		その他 ()
資産複合 ()		エマージング		
資産配分固定 型				
資産配分変更 型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）をご覧ください。

（２）【ファンドの沿革】

2011年12月9日	信託契約締結、設定、運用開始。
2017年9月21日	「三井住友・DC日本株式インデックスファンドS」から「三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド」に名称を変更。

（３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

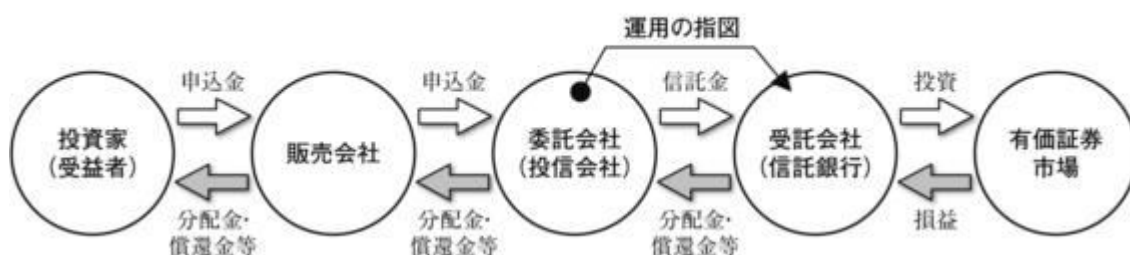
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（ハ）販売会社

委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

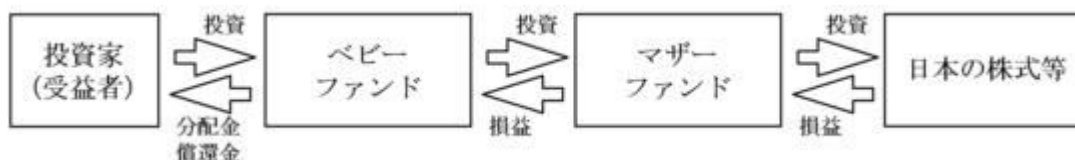
委託会社は販売会社としての役割も有します。

運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（2018年6月29日現在）

(ロ) 会社の沿革

- 1985年 7月15日 三生投資顧問株式会社設立
- 1987年 2月20日 証券投資顧問業の登録
- 1987年 6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可
- 1999年 1月 1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
- 1999年 2月 5日 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
- 2000年 1月27日 証券投資信託委託業の認可取得
- 2002年12月 1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
- 2013年 4月 1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

(ハ) 大株主の状況

（2018年6月29日現在）

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	10,584	60.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528	20.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	3,528	20.0

2【投資方針】

(1)【投資方針】

イ 基本方針

当ファンドは、マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

- (イ) マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。
- (ハ) 株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。
- (ニ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

(ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドの特色

1

マザーファンドへの投資を通じて、主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

- 東証1部銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、マルチファクターモデルを活用した最適化法により、推定トラッキングエラーの低減のみならず制約条件を加えることで、実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。
- TOPIX(東証株価指数、配当込み)との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。



TOPIXとは

東京証券取引所第1部に上場しているすべての銘柄(内国普通株式)の時価総額を指数化し株式市場の動向を捉えようとするものであり、東京証券取引所が算出、公表を行っています。

TOPIXは、東京証券取引所の知的財産で、この指数の算出、数値の公表、利用などこの指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

2

株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

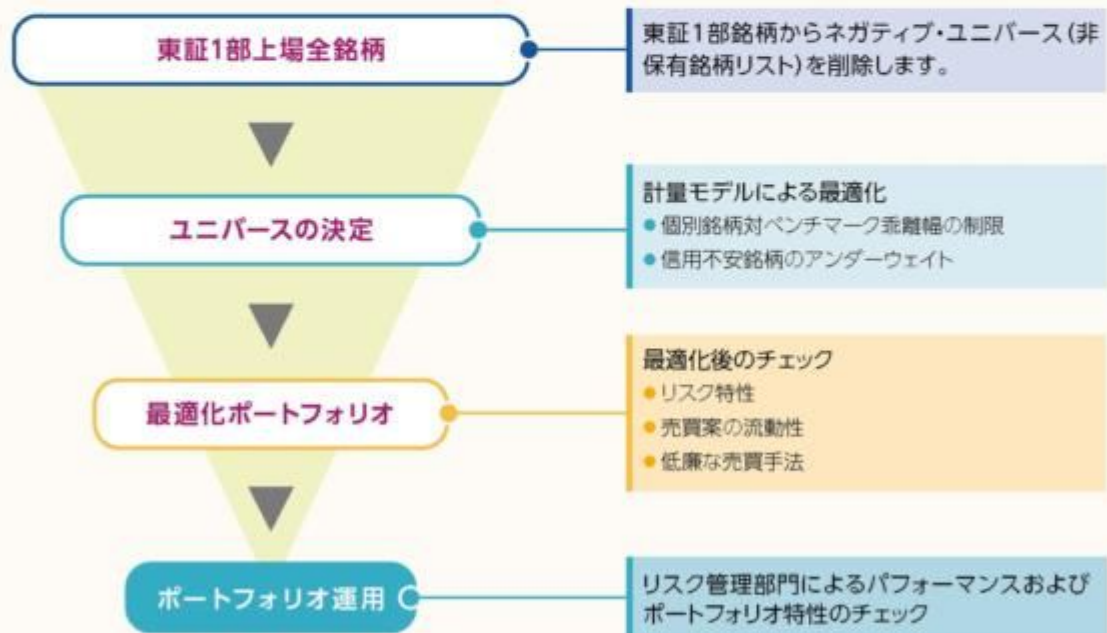
※ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドのしくみ

■ファミリーファンド方式を採用し、マザーファンドの組入れを通じて、実際の運用を行います。



運用プロセス



最適化(法)とは

計量モデル等に基づいて、インデックスとの連動性を保てるように一部の銘柄を抽出してポートフォリオを構築する方法です。

信用不安が懸念される銘柄を排除することや少額でもポートフォリオを構築することができるメリットがあります。

ベンチマークの推移

- ・以下のグラフは、ファンドのベンチマーク(TOPIX(東証株価指数、配当込み))の推移です。
- ・ファンドの値動きのイメージをつかんでいただくため、ベンチマークの推移と国内外の主要な出来事を合わせて記載したものであり、ファンドの運用実績ではありません。
- ・ファンドの実際の運用実績は、後掲「基準価額・純資産の推移」をご覧ください。
- ・ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。



※データは1998年6月末～2018年6月末、1998年6月末を100として指数化。

※有価証券売買時のコストや信託報酬等の費用負担、組入有価証券の売買のタイミング差等の影響から、当ファンドの値動きは上記推移とは異なります。

※ベンチマーク(TOPIX(東証株価指数、配当込み))の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

(2) 【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

(イ) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

1. 有価証券
2. デリバティブ取引にかかる権利
3. 約束手形
4. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンド受益証券または次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。)および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
 14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
 15. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 16. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。)
 17. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券(ただし、投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

八 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(3) 【運用体制】

イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

(イ) 計画 (Plan)

国内外のエコノミスト、アナリスト、ファンドマネージャーが、マクロ経済環境、市場環境に関する分析・検討を行います。

これを元に、担当運用グループは投資政策委員会にて、運用方針を決定し月次運用計画を策定します。

(ロ) 実行 (Do)

担当運用グループは、月次運用計画に基づき、ファンドのポートフォリオの構築、およびポートフォリオ管理の一環として日々のリスクモニタリングを行います。

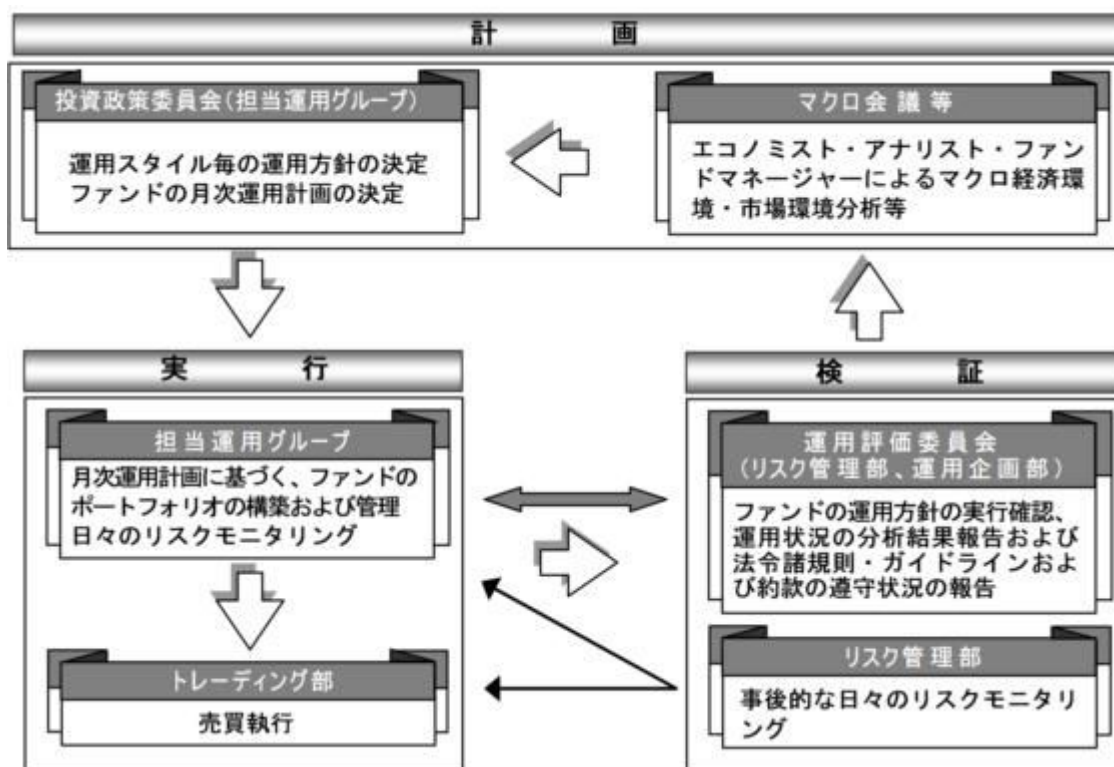
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

(ハ) 検証 (Check)

運用部門から組織的に分離されたリスク管理部が、約款の遵守状況等、ファンドの運営状況を日々モニタリングし、抵触があった場合直ちに担当運用グループへ状況確認がなされます。担当運用グループは対応結果をリスク管理部へ報告します。

運用評価委員会では、ファンドの運用方針の実行状況、運用状況の分析結果を確認します。また、運用の分析、評価結果、運用リスク状況、法令諸規則、運用ガイドライン、約款の遵守状況についても報告されます。

【ファンドの運用体制】



リスク管理部は11名程度、運用企画部は11名程度で構成されています。

ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

- 委託会社によるファンドの関係法人(販売会社を除く)に対する管理体制
ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務(保管・管理・計算等)を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

(4)【分配方針】

年1回(原則として毎年11月30日。ただし、休業日の場合は翌営業日。)決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配金額を決定します。

- イ 分配対象額は、経費控除後の利子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。
- 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。(基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。)

(5)【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率(「組入比率」といいます。)と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます(以下同じ。)
- 外貨建資産への投資は行いません。
- ハ 投資信託証券(マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- ニ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- ホ デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

- イ 投資する株式等の範囲
(イ) 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
(ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投

資することを指図することができるものとします。

ロ 信用取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ニ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ハ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、日本の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- (ロ) 委託会社は、日本の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

ニ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

ホ 金利先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、金利先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 金利先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により

行うものとしします。

- (ホ) 委託会社は、金利先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとしします。
- (ヘ) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」といいます。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」といいます。）までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」といいます。）の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

ヘ 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
 1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとしします。
 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとしします。
- (ロ) 上記(イ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとしします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとしします。

ト 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができますものとしします。
- (ロ) 上記(イ)の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとしします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとしします。

チ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとしします。
- (ロ) 上記(イ)の指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとしします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとしします。
- (ニ) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとしします。
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、有価証券等の売却代金、解約代金また

は償還金の入金日までに限るものとし、資金借入額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

(ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

(ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

ヌ デリバティブ取引等にかかる投資制限

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

法令に基づく投資制限

イ 同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

ロ デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

ハ 信用リスク集中回避のための投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2)

委託会社は、運用財産に関し、信用リスク(保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。)を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

(参考情報:国内株式インデックス・マザーファンド(B号)の投資方針等)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

主として日本の株式に投資し、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

(イ) 主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

(ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（八）株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １．株券または新株引受権証書
- ２．国債証券
- ３．特別の法律により法人の発行する債券
- ４．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
- ５．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
- ６．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- ７．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

ハ 投資対象とする金融商品

前記「２ 投資方針 （２）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品の各号のうち、第１号から第４号に掲げるものに投資します。

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ハ）一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

（ニ）デリバティブ取引（法人税法第61条の５に定めるものをいいます。）は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、主に日本の株式を投資対象としています（マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。）。当ファンドの基準価額は、組み入れた株式の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化等の影響により上下します。基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

当ファンドが有するリスク等（当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドへの投資を通じ

て間接的に受ける実質的なリスク等を含みます。)のうち主要なものは、以下の通りです。

(イ) 株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

(ロ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

(ハ) 市場流動性リスク

ファンドの資金流出入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ニ) 指数の動きと連動しない要因

当ファンドは、TOPIX(東証株価指数、配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、有価証券売買時のコストおよび信託報酬その他のファンド運営にかかる費用、追加設定・解約に伴う組入有価証券の売買のタイミング差、インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差の影響、株価指数先物とインデックスとの動きの不一致等から、上記インデックスの動きに連動しないことがあります。

(ホ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(ヘ) 換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

(ト) 収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。



分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

ロ 投資リスクの管理体制

リスク管理の実効性を高め、また、コンプライアンスの徹底を図るために、運用部門から独立した組織（リスク管理部および法務コンプライアンス部）を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる確認等を行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングを行います。また、法務コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についての確認等を行います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

（参考情報）投資リスクの定量的比較

〔 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 〕

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。



※年間騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕

ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて、各月末における1年間の騰落率の平均・最大・最小を比較したものです。



※ファンドの騰落率は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(配当込み) 株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

無手数料です。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に年0.1728%（税抜き0.16%）の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。

信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き） >

支払先	料率	役務の内容
委託会社	年0.07%	ファンド運用の指図等の対価
販売会社	年0.07%	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	年0.02%	ファンド財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

上記の各支払先の料率には別途消費税等相当額がかかります。

委託会社が販売会社として募集の取扱い等をした部分については、販売会社配分相当額も委託会社が収受します。

(4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.0054%（税抜き0.005%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

上記(1)～(4)にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあつたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

(5) 【課税上の取扱い】

- イ 個別元本について

- (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

ロ 一部解約時および償還時の課税について

個人の受益者については、一部解約時および償還時の譲渡益が課税対象となり、法人の受益者については、一部解約時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

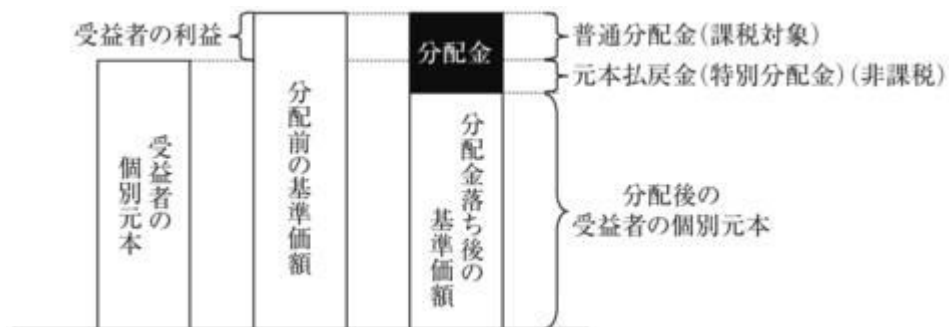
ハ 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。



収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



上記の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

・一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、20.315%（所得税15.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および利子等、他の上場株式等にかかる譲渡益および配当等との通算が可能です。

(ロ) 法人の受益者に対する課税


収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。また、当ファンドは非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「つみたてNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAおよびつみたてNISAでの取扱い対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、当ファンドは、配当控除の適用が可能です。

つみたてNISA（ニーサ）、NISA（ニーサ）、ジュニアNISA（ニーサ）をご利用になる場合、それぞれの制度の違いにご留意ください。また、販売会社での専用口座の開設等、一定の要件があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

	非課税累積投資契約に係る 少額投資非課税制度 つみたてNISA	少額投資非課税制度 NISA	未成年者少額投資 非課税制度 ジュニアNISA
対象となる 投資信託	一定の要件を満たした 公募株式投資信託 (新たに積立投資が必要)	公募株式投資信託 (新たに購入が必要)	
非課税対象	公募株式投資信託から生じる配当所得および譲渡所得		
利用対象と なる方	20歳以上の日本居住者 (専用口座が開設される年の1月1日現在)		0～19歳の日本居住者 (専用口座が開設される年の 1月1日現在)
非課税の期間	最長20年間 (投資期間は2037年まで)	最長5年間 (投資期間は2023年まで)	
利用できる 限度額	40万円/年 (最大800万円)	120万円/年 (最大600万円)	80万円/年 (最大400万円)
留意事項	 つみたてNISAとNISAを併用した投資を行うことはできません。		

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への投資は行いません。

株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産

に属する株式以外の資産のうち、当ファンドの信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

上記にかかわらず、確定拠出年金制度における受益者が支払いを受ける収益分配金、一部解約金、償還金はいずれも課税されません。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、2018年6月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

2018年 6月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	15,108,085,530	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,150,822	0.01
合計(純資産総額)		15,105,934,708	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。以下同じ。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

イ 主要投資銘柄

2018年 6月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・マ ザーファンド(B号)	5,666,948,811	2.7231	15,431,795,708	2.6660	15,108,085,530	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

2018年 6月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

【投資不動産物件】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1期 (2012年11月30日)	46,382,401	46,382,401	10,686	10,686
第2期 (2013年12月 2日)	240,904,868	240,904,868	17,489	17,489
第3期 (2014年12月 1日)	1,199,235,666	1,199,235,666	20,086	20,086
第4期 (2015年11月30日)	1,883,008,758	1,883,008,758	22,695	22,695
第5期 (2016年11月30日)	3,038,772,746	3,038,772,746	21,507	21,507
第6期 (2017年11月30日)	9,561,101,750	9,561,101,750	26,725	26,725
2017年 6月末日	5,820,251,459		23,857	
7月末日	6,289,698,106		23,958	
8月末日	6,779,725,451		23,943	
9月末日	7,508,453,464		24,978	
10月末日	8,715,825,449		26,336	
11月末日	9,561,101,750		26,725	
12月末日	10,427,388,596		27,133	
2018年 1月末日	11,350,759,289		27,414	
2月末日	11,791,055,897		26,396	
3月末日	12,301,640,171		25,857	

4月末日	13,474,801,611		26,778
5月末日	14,330,789,489		26,337
6月末日	15,105,934,708		26,117

【分配の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期	2011年12月9日～2012年11月30日	0
第2期	2012年12月1日～2013年12月2日	0
第3期	2013年12月3日～2014年12月1日	0
第4期	2014年12月2日～2015年11月30日	0
第5期	2015年12月1日～2016年11月30日	0
第6期	2016年12月1日～2017年11月30日	0

【収益率の推移】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

	収益率(%)
第1期	6.9
第2期	63.7
第3期	14.8
第4期	13.0
第5期	5.2
第6期	24.3
第7期(中間期)	1.5

(注) 収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

(4) 【設定及び解約の実績】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第1期	48,834,286	5,429,211
第2期	142,006,965	47,664,219
第3期	519,901,426	60,604,357
第4期	344,299,728	111,646,738
第5期	769,510,936	186,265,298

第6期	2,809,793,582	645,206,011
第7期(中間期)	2,392,245,095	528,415,497

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

(1) 投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2018年 6月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	172,843,303,270	97.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,790,956,913	2.70
合計(純資産総額)		177,634,260,183	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,828,095,000	2.71
合計	買建		4,828,095,000	2.71

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2018年 6月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	849,900	7,052.86	5,994,225,714	7,170.00	6,093,783,000	3.43

日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,826,300	793.27	3,828,559,001	631.10	3,045,877,930	1.71
日本	株式	ソニー	電気機器	467,300	5,207.86	2,433,632,978	5,664.00	2,646,787,200	1.49
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	492,500	5,871.13	2,891,531,525	5,036.00	2,480,230,000	1.40
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	310,700	9,484.65	2,946,880,755	7,973.00	2,477,211,100	1.39
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	522,000	4,556.53	2,378,508,660	4,306.00	2,247,732,000	1.27
日本	株式	キーエンス	電気機器	34,300	64,992.79	2,229,252,697	62,560.00	2,145,808,000	1.21
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	629,100	3,747.97	2,357,847,927	3,253.00	2,046,462,300	1.15
日本	株式	KDDI	情報・通信業	605,000	3,209.34	1,941,650,700	3,031.00	1,833,755,000	1.03
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,370,500	204.06	1,912,144,230	186.50	1,747,598,250	0.98
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	515,500	2,648.84	1,365,477,020	3,066.00	1,580,523,000	0.89
日本	株式	任天堂	その他製品	43,000	45,258.53	1,946,116,790	36,200.00	1,556,600,000	0.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	483,100	2,817.70	1,361,230,870	3,078.00	1,486,981,800	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	66,400	27,996.28	1,858,952,992	22,005.00	1,461,132,000	0.82
日本	株式	花王	化学	171,900	7,442.34	1,279,338,246	8,450.00	1,452,555,000	0.82
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	62,600	20,779.47	1,300,794,822	22,960.00	1,437,296,000	0.81
日本	株式	日本電産	電気機器	84,100	15,306.83	1,287,304,403	16,625.00	1,398,162,500	0.79
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	288,800	4,604.50	1,329,779,600	4,831.00	1,395,192,800	0.79
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	492,100	2,905.43	1,429,762,103	2,822.50	1,388,952,250	0.78
日本	株式	キヤノン	電気機器	376,400	4,298.90	1,618,105,960	3,631.00	1,366,708,400	0.77
日本	株式	村田製作所	電気機器	73,300	15,180.52	1,112,732,116	18,620.00	1,364,846,000	0.77
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	259,700	4,965.27	1,289,480,619	5,193.00	1,348,622,100	0.76
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	434,100	3,719.42	1,614,600,222	3,095.00	1,343,539,500	0.76
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	125,500	10,872.14	1,364,453,570	10,615.00	1,332,182,500	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	1,678,000	835.58	1,402,103,240	781.60	1,311,524,800	0.74
日本	株式	ダイキン工業	機械	95,400	12,936.70	1,234,161,180	13,270.00	1,265,958,000	0.71
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	257,600	6,189.36	1,594,379,136	4,678.00	1,205,052,800	0.68
日本	株式	パナソニック	電気機器	798,100	1,668.58	1,331,693,698	1,493.50	1,191,962,350	0.67
日本	株式	信越化学工業	化学	120,700	11,776.68	1,421,445,276	9,873.00	1,191,671,100	0.67
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	688,000	1,425.83	980,971,040	1,689.00	1,162,032,000	0.65

□ 種別・業種別の投資比率

2018年 6月29日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.29
		建設業	3.09
		食料品	4.38
		繊維製品	0.63
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.22
		医薬品	4.61
		石油・石炭製品	0.74
		ゴム製品	0.80
		ガラス・土石製品	0.97
		鉄鋼	0.99
		非鉄金属	0.83
		金属製品	0.61
		機械	5.01
		電気機器	13.26
		輸送用機器	8.38
		精密機器	1.68
		その他製品	2.03
		電気・ガス業	1.72
		陸運業	4.26
		海運業	0.18
		空運業	0.56
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	7.30
		卸売業	4.67
		小売業	4.90
		銀行業	6.48
		証券、商品先物取引業	0.90
		保険業	2.20
その他金融業	1.18		
不動産業	2.36		
サービス業	4.50		
合計			97.30

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2018年 6月29日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	279	日本円	4,894,721,320	4,828,095,000	2.71

（注）主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

参考情報

基準日:2018年6月29日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
 ※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

基準価額・純資産の推移



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

分配の推移

決算期	分配金
2017年11月	0円
2016年11月	0円
2015年11月	0円
2014年12月	0円
2013年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。
 ※直近5計算期間を記載しています。

主要な資産の状況

■三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.01
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	100.01

■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	97.30
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.70
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.71%

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.43
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.71
日本	株式	ソニー	電気機器	1.49
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.40
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.39
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.27
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.21
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1.15
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.03
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	0.98

※比率は、当ファンド、マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

※「主要投資銘柄(上位10銘柄)」は組入る有価証券が10銘柄に満たない場合はすべてを記載しています。

年間収益率の推移(暦年ベース)



※換金時に費用・税金などがかかる場合があります。したがって、ファンドの収益率は実際の投資家利回りとは異なります。
 ※2011年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2011年12月9日)から年末までの騰落率を表示しています。
 ※2018年の収益率は、年初から2018年6月29日までの騰落率を表示しています。
 ※ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

当ファンドには、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」の2つの申込方法がありますが、販売会社によってはいずれか一方のみの取扱いとなる場合があります。お申込みの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

(ロ) 原則として午後3時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。

(ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

ロ 申込価額

取得申込受付日の基準価額となります。

ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

ハ 申込手数料

無手数料です。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

申込単位の詳細についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ ホームページ・アドレス

三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com
--------------------	--------------	------------------------

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

へ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、申込金額(取得申込受付日の基準価額×申込口数)を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

2【換金(解約)手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求(一部解約の実行請求)により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の基準価額となります。

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社(電話:0120-88-2976)にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産(受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます(基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。)

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「DC積N日株」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ ホームページ・アドレス
--------	------	-------------------------

三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com
--------------------	--------------	------------------------

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

(2) 【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

2011年12月9日から下記「(5) その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4) 【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

（八）委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

（二）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。
分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。
ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（ロ）償還金

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。

八 信託約款の変更等

- （イ）委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- （ロ）委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- （ハ）上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じ

て、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- (二) 書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(二)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合にあっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれから、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継されることがあります。

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<http://www.smam-jp.com>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書(全体版)および運用報告書(全体版)の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページで閲覧できます。

4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分にに応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にか

かる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ハ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

ニ 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行行使することができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

- 1 . 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 . 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期(平成28年12月 1日から平成29年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (平成28年11月30日現在)	第6期 (平成29年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	10,684,061	1,531,711
コール・ローン	3,094,407	36,067,647
親投資信託受益証券	3,041,168,741	9,567,976,252
未収入金	4,429,200	-
流動資産合計	3,059,376,409	9,605,575,610
資産合計	3,059,376,409	9,605,575,610
負債の部		
流動負債		
未払解約金	18,207,360	37,587,190
未払受託者報酬	368,620	964,366
未払委託者報酬	1,965,926	5,730,821
未払利息	9	105
その他未払費用	61,748	191,378
流動負債合計	20,603,663	44,473,860
負債合計	20,603,663	44,473,860
純資産の部		
元本等		
元本	1,412,943,518	3,577,531,089
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,625,829,228	5,983,570,661
元本等合計	3,038,772,746	9,561,101,750
純資産合計	3,038,772,746	9,561,101,750
負債純資産合計	3,059,376,409	9,605,575,610

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期		第6期	
	自	平成27年12月 1日 至 平成28年11月30日	自	平成28年12月 1日 至 平成29年11月30日
営業収益				
受取利息		10		-
有価証券売買等損益		10,148,314		1,325,226,967
営業収益合計		10,148,324		1,325,226,967
営業費用				
支払利息		1,589		13,277
受託者報酬		651,571		1,577,757
委託者報酬		3,474,915		9,002,148
その他費用		109,140		294,941
営業費用合計		4,237,215		10,888,123
営業利益又は営業損失（ ）		5,911,109		1,314,338,844
経常利益又は経常損失（ ）		5,911,109		1,314,338,844
当期純利益又は当期純損失（ ）		5,911,109		1,314,338,844
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		36,189,927		109,904,353
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,053,310,878		1,625,829,228
剰余金増加額又は欠損金減少額		751,027,594		3,943,194,341
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		751,027,594		3,943,194,341
剰余金減少額又は欠損金増加額		220,610,280		789,887,399
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		220,610,280		789,887,399
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,625,829,228		5,983,570,661

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第6期
	自 平成28年12月 1日 至 平成29年11月30日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（ 追加情報 ）

第6期
自 平成28年12月 1日 至 平成29年11月30日
<p>当ファンドは、2018年1月より開始される「つみたてNISA」制度への対応として、平成29年9月21日付けでファンド名称を「三井住友・DC日本株式インデックスファンドS」から「三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド」に変更する約款変更を行いました。</p>

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第5期	第6期
	(平成28年11月30日現在)	(平成29年11月30日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,412,943,518口	3,577,531,089口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 2.1507円 21,507円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 2.6725円 26,725円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第5期	第6期
	自 平成27年12月 1日 至 平成28年11月30日	自 平成28年12月 1日 至 平成29年11月30日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（40,423,422円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,677,614円）、収益調整金（1,311,027,669円）、および分配準備積立金（272,700,523円）より、分配対象収益は1,625,829,228円（1万口当たり11,506.66円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（113,343,744円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,091,090,747円）、収益調整金（4,545,536,041円）、および分配準備積立金（233,600,129円）より、分配対象収益は5,983,570,661円（1万口当たり16,725.39円）であります。分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

項目	第6期
	自 平成28年12月 1日 至 平成29年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 (平成29年11月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第5期（自 平成27年12月 1日 至 平成28年11月30日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	27,440,289円
合計	27,440,289円

第6期（自 平成28年12月 1日 至 平成29年11月30日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,317,897,781円
合計	1,317,897,781円

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第6期 自 平成28年12月 1日 至 平成29年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

項 目	第5期 （平成28年11月30日現在）	第6期 （平成29年11月30日現在）
期首元本額	829,697,880円	1,412,943,518円
期中追加設定元本額	769,510,936円	2,809,793,582円
期中一部解約元本額	186,265,298円	645,206,011円

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	3,512,215,055	9,567,976,252	
合計		3,512,215,055	9,567,976,252	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンドは、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

貸借対照表

（単位：円）

	（平成28年11月30日現在）	（平成29年11月30日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,526,081,967	100,867,335
コール・ローン	731,624,938	2,375,152,044
株式	200,450,853,880	190,034,814,150
派生商品評価勘定	128,254,000	22,657,360
未収入金	-	189,200
未収配当金	1,207,087,166	1,103,825,887
差入委託証拠金	22,650,000	17,655,000
流動資産合計	205,066,551,951	193,655,160,976
資産合計	205,066,551,951	193,655,160,976
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	834,320
前受金	128,335,000	21,890,000
未払解約金	239,375,544	607,066,570
未払利息	2,144	6,962
その他未払費用	68,042	58,774
流動負債合計	367,780,730	629,856,626
負債合計	367,780,730	629,856,626

（平成28年11月30日現在）

（平成29年11月30日現在）

純資産の部		
元本等		
元本	93,628,160,347	70,854,907,568
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	111,070,610,874	122,170,396,782
元本等合計	204,698,771,221	193,025,304,350
純資産合計	204,698,771,221	193,025,304,350
負債純資産合計	205,066,551,951	193,655,160,976

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成28年12月 1日 至 平成29年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成28年11月30日現在）	（平成29年11月30日現在）
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,324,500,000円</p>	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,522,000,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	93,628,160,347口	70,854,907,568口
3. 1単位当たり純資産の	1口当たり純資産額 2.1863円	1口当たり純資産額 2.7242円

額	(10,000口当たりの純資産額	21,863円)	(10,000口当たりの純資産額	27,242円)
---	------------------	----------	------------------	----------

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成28年12月 1日 至 平成29年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成29年11月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成28年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,146,346,000	-	4,274,600,000	128,254,000
	東証株価指数先物	4,146,346,000	-	4,274,600,000	128,254,000
合計		4,146,346,000	-	4,274,600,000	128,254,000

（平成29年11月30日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,781,496,960	-	2,803,320,000	21,823,040
	東証株価指数先物	2,781,496,960	-	2,803,320,000	21,823,040
合計		2,781,496,960	-	2,803,320,000	21,823,040

（注）1．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成28年12月 1日 至 平成29年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

（その他の注記）

（平成28年11月30日現在）
開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	97,649,281,775円
同期中における追加設定元本額	21,580,495,893円
同期中における一部解約元本額	25,601,617,321円
平成28年11月30日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,175,044,506円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	566,683,968円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,748,752,313円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,966,264,683円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	118,298,305円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,827,446円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	23,369,792円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	60,888,460円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	56,096,815円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	30,502,259円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	74,957,122円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	2,127,403,424円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	1,391,011,637円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,927,229,409円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,980,111,432円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	2,323,999,880円
イオン・バランス戦略ファンド	31,755,756円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,762,845円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	14,630,089,299円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	74,235,620円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉	10,921,926,986円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	5,928,139,959円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	3,506,753,841円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	12,994,345,718円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	72,262,813円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	318,914,967円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	14,442,621円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	1,359,747,939円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型〈適格機関投資家限定〉	79,014,405円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	510,341,880円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	1,556,018,951円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	2,629,403,754円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	4,574,012,622円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	118,317,004円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,273,096,206円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	102,877,758円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	163,643,207円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,540,651,763円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	146,094,154円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	67,167,084円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	32,274,637円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	317,606,290円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	530,906,900円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	242,434,474円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	158,652,472円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	77,146,993円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	12,767,533円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	104,475,263円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,386,827,064円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・V A (適格機関投資家専用)	255,155,917円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	28,000,161円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	24,037円
S M A M ・ F G グローバルバランス2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	496,588円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド（安定成長型）< 適格機関投資家限定 >	786,297円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	265,875円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	134,448,755円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	64,432,247円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	85,000,241円
合計	93,628,160,347円

(平成29年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	93,628,160,347円
同期中における追加設定元本額	15,411,032,124円
同期中における一部解約元本額	38,184,284,903円
平成29年11月30日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,703,522,595円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	601,574,522円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,941,578,441円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,159,565,951円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	146,867,685円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020（4資産タイプ）	7,072,256円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	21,737,956円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030（4資産タイプ）	56,441,195円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035（4資産タイプ）	61,403,830円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	34,583,133円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045（4資産タイプ）	93,675,761円
国内株式指数ファンド（T O P I X）	1,258,548,287円
三井住友・DCつみたてN I S A ・日本株インデックスファンド	3,512,215,055円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	548,727,701円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	870,164,102円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	880,688,782円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,694,364円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	77,419円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	621,209円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	2,792,550円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	9,419,639円

三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	12,475,217円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	892,449円
SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	8,293,658,882円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	35,192,008円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉	3,593,405,593円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	4,224,570,178円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	2,707,437,600円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	9,990,760,791円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	59,777,193円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	243,672,433円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	1,569,299円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	1,083,328,933円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型〈適格機関投資家限定〉	64,742,845円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	405,784,462円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	1,167,685,548円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	1,475,624,119円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	3,514,768,578円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	88,244,909円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,527,265,717円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	75,601,383円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	118,198,824円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,778,332,732円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	115,908,138円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	52,998,705円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	23,441,238円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	229,793,791円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	412,464,457円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	174,873,606円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	123,105,106円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	61,153,864円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	11,244,478円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉	80,230,517円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉	1,044,312,649円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	209,546,573円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2〈適格機関投資家専用〉	21,310,839円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA〈適格機関投資家限定〉	1,910,689,341円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA〈適格機関投資家限定〉	292,412,489円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	1,772,189,307円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	477,821,118円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド〈適格機関投資家限定〉	300,693円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04〈適格機関投資家限定〉	192,135,872円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05〈適格機関投資家限定〉	92,009,873円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン〈適格機関投資家限定〉	179,002,788円
合計	70,854,907,568円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,500	3,850.00	13,475,000	
日本水産	94,600	614.00	58,084,400	
マルハニチロ	15,600	3,230.00	50,388,000	
カネコ種苗	4,100	1,683.00	6,900,300	
サカタのタネ	12,000	3,715.00	44,580,000	
ホクト	8,400	2,018.00	16,951,200	
住石ホールディングス	10,000	149.00	1,490,000	
日鉄鉱業	2,300	7,670.00	17,641,000	
三井松島産業	5,000	1,393.00	6,965,000	
国際石油開発帝石	405,000	1,265.00	512,325,000	
日本海洋掘削	3,200	2,351.00	7,523,200	
石油資源開発	13,200	2,573.00	33,963,600	
K & O エナジーグループ	5,100	1,948.00	9,934,800	
ショーボンドホールディングス	7,700	7,120.00	54,824,000	
ミライト・ホールディングス	25,200	1,503.00	37,875,600	
タマホーム	9,900	710.00	7,029,000	
インベスターズクラウド	1,600	6,660.00	10,656,000	
ダイセキ環境ソリューション	3,600	1,405.00	5,058,000	
安藤・間	63,800	887.00	56,590,600	
東急建設	31,200	1,085.00	33,852,000	
コムシスホールディングス	29,200	3,135.00	91,542,000	
ミサワホーム	8,100	994.00	8,051,400	
ピーアールホールディングス	10,900	418.00	4,556,200	
高松コンストラクショングループ	5,300	2,896.00	15,348,800	
東建コーポレーション	3,000	14,090.00	42,270,000	
大成建設	84,500	5,900.00	498,550,000	
大林組	248,800	1,452.00	361,257,600	
清水建設	253,700	1,247.00	316,363,900	
飛島建設	87,000	162.00	14,094,000	
長谷工コーポレーション	96,600	1,743.00	168,373,800	
松井建設	11,300	952.00	10,757,600	
銭高組	1,400	6,720.00	9,408,000	
鹿島建設	365,000	1,179.00	430,335,000	
不動テトラ	71,700	184.00	13,192,800	

鉄建建設	5,100	3,360.00	17,136,000
西松建設	19,200	3,255.00	62,496,000
三井住友建設	60,000	640.00	38,400,000
大豊建設	30,000	580.00	17,400,000
前田建設工業	59,300	1,651.00	97,904,300
ナカノフドー建設	8,600	610.00	5,246,000
奥村組	13,700	4,565.00	62,540,500
東鉄工業	9,700	3,675.00	35,647,500
イチケン	2,000	2,392.00	4,784,000
浅沼組	31,000	397.00	12,307,000
戸田建設	97,000	896.00	86,912,000
熊谷組	13,000	3,125.00	40,625,000
青木あすなろ建設	6,500	1,015.00	6,597,500
北野建設	21,000	411.00	8,631,000
三井ホーム	13,000	683.00	8,879,000
矢作建設工業	12,600	992.00	12,499,200
ピーエス三菱	11,600	884.00	10,254,400
日本ハウスホールディングス	19,000	623.00	11,837,000
大東建託	30,100	20,545.00	618,404,500
新日本建設	10,400	938.00	9,755,200
N I P P O	19,000	2,657.00	50,483,000
東亜道路工業	2,000	4,605.00	9,210,000
前田道路	26,000	2,533.00	65,858,000
日本道路	2,500	6,750.00	16,875,000
東亜建設工業	6,800	3,060.00	20,808,000
若築建設	5,800	1,752.00	10,161,600
東洋建設	26,400	626.00	16,526,400
五洋建設	99,000	837.00	82,863,000
世紀東急工業	13,900	604.00	8,395,600
福田組	2,700	6,870.00	18,549,000
住友林業	53,100	1,930.00	102,483,000
日成ビルド工業	12,300	1,371.00	16,863,300
ヤマダ・エスバイエルホーム	67,000	80.00	5,360,000
大和ハウス工業	245,600	4,114.00	1,010,398,400
ライト工業	16,000	1,248.00	19,968,000
積水ハウス	270,800	2,094.50	567,190,600
日特建設	10,400	673.00	6,999,200
北陸電気工事	5,400	1,072.00	5,788,800
ユアテック	13,500	979.00	13,216,500
中電工	9,900	3,225.00	31,927,500
関電工	32,100	1,105.00	35,470,500
きんでん	55,200	1,913.00	105,597,600

東京エネシス	9,800	1,305.00	12,789,000
トーエネック	2,800	3,250.00	9,100,000
住友電設	6,700	2,432.00	16,294,400
日本電設工業	12,600	2,342.00	29,509,200
協和エクシオ	30,000	2,698.00	80,940,000
新日本空調	7,500	1,458.00	10,935,000
N D S	1,800	4,290.00	7,722,000
九電工	16,400	5,320.00	87,248,000
三機工業	17,400	1,386.00	24,116,400
日揮	71,700	1,951.00	139,886,700
中外炉工業	3,600	2,182.00	7,855,200
ヤマト	9,200	795.00	7,314,000
太平電業	5,700	2,649.00	15,099,300
高砂熱学工業	22,600	2,092.00	47,279,200
朝日工業社	2,300	3,380.00	7,774,000
明星工業	16,300	806.00	13,137,800
大気社	10,800	3,770.00	40,716,000
ダイダン	5,600	3,075.00	17,220,000
日比谷総合設備	9,400	2,469.00	23,208,600
東芝プラントシステム	17,900	2,127.00	38,073,300
O S J Bホールディングス	38,800	329.00	12,765,200
東洋エンジニアリング	10,200	1,272.00	12,974,400
千代田化工建設	54,000	736.00	39,744,000
新興プランテック	16,800	1,137.00	19,101,600
日本製粉	23,700	1,657.00	39,270,900
日清製粉グループ本社	89,900	2,196.00	197,420,400
日東富士製粉	1,500	4,600.00	6,900,000
昭和産業	6,600	2,879.00	19,001,400
鳥越製粉	9,400	1,011.00	9,503,400
中部飼料	9,200	2,265.00	20,838,000
フィード・ワン	50,800	286.00	14,528,800
日本甜菜製糖	5,300	2,702.00	14,320,600
三井製糖	5,800	4,600.00	26,680,000
日新製糖	4,100	2,132.00	8,741,200
森永製菓	17,600	5,630.00	99,088,000
中村屋	2,600	5,000.00	13,000,000
江崎グリコ	20,800	5,550.00	115,440,000
名糖産業	5,300	1,505.00	7,976,500
不二家	5,800	2,587.00	15,004,600
山崎製パン	60,800	2,166.00	131,692,800
モロゾフ	1,600	7,470.00	11,952,000
亀田製菓	4,600	5,350.00	24,610,000

寿スピリッツ	7,100	5,420.00	38,482,000
カルビー	34,100	3,925.00	133,842,500
森永乳業	15,000	4,590.00	68,850,000
六甲バター	4,200	2,720.00	11,424,000
ヤクルト本社	44,500	8,760.00	389,820,000
明治ホールディングス	49,000	9,780.00	479,220,000
雪印メグミルク	18,200	3,120.00	56,784,000
プリマハム	51,000	781.00	39,831,000
日本ハム	64,000	2,757.00	176,448,000
丸大食品	39,000	496.00	19,344,000
S Foods	5,100	4,830.00	24,633,000
伊藤ハム米久ホールディングス	42,100	1,016.00	42,773,600
サッポロホールディングス	27,300	3,515.00	95,959,500
アサヒグループホールディングス	156,100	5,707.00	890,862,700
キリンホールディングス	358,100	2,629.50	941,623,950
宝ホールディングス	60,700	1,257.00	76,299,900
オエノンホールディングス	28,900	355.00	10,259,500
養命酒製造	3,500	2,460.00	8,610,000
コカ・コーラボトラーズジャパン	52,000	4,265.00	221,780,000
サントリー食品インターナショナル	56,500	4,860.00	274,590,000
ダイドーグループホールディングス	3,800	5,790.00	22,002,000
伊藤園	24,800	4,180.00	103,664,000
キーコーヒー	7,500	2,147.00	16,102,500
日清オイリオグループ	8,600	3,455.00	29,713,000
不二製油グループ本社	20,400	3,265.00	66,606,000
かどや製油	1,100	7,000.00	7,700,000
J - オイルミルズ	3,900	4,030.00	15,717,000
キッコーマン	57,600	4,400.00	253,440,000
味の素	171,500	2,064.00	353,976,000
キューピー	42,500	2,885.00	122,612,500
ハウス食品グループ本社	28,400	3,660.00	103,944,000
カゴメ	30,000	4,165.00	124,950,000
焼津水産化学工業	7,800	1,208.00	9,422,400
アリアケジャパン	6,600	10,180.00	67,188,000
ニチレイ	35,400	3,260.00	115,404,000
東洋水産	40,700	4,780.00	194,546,000
日清食品ホールディングス	32,300	8,110.00	261,953,000
永谷園ホールディングス	10,000	1,389.00	13,890,000
一正蒲鉾	4,600	1,295.00	5,957,000
フジッコ	8,200	2,539.00	20,819,800
ロック・フィールド	8,000	2,073.00	16,584,000
日本たばこ産業	461,100	3,720.00	1,715,292,000

ケンコーマヨネーズ	5,000	3,425.00	17,125,000
わらべや日洋ホールディングス	5,000	2,995.00	14,975,000
なとり	5,300	2,041.00	10,817,300
北の達人コーポレーション	7,700	1,095.00	8,431,500
ユーグレナ	29,200	1,112.00	32,470,400
ミヨシ油脂	4,900	1,518.00	7,438,200
理研ビタミン	3,100	4,480.00	13,888,000
片倉工業	10,800	1,305.00	14,094,000
グンゼ	5,800	5,880.00	34,104,000
東洋紡	29,600	2,047.00	60,591,200
ユニチカ	22,200	836.00	18,559,200
富士紡ホールディングス	4,400	3,485.00	15,334,000
倉敷紡績	79,000	343.00	27,097,000
シキボウ	5,700	1,412.00	8,048,400
日本毛織	22,500	992.00	22,320,000
帝国繊維	8,600	2,218.00	19,074,800
帝人	63,500	2,420.00	153,670,000
東レ	565,100	1,057.00	597,310,700
サカイオーベックス	2,700	2,610.00	7,047,000
住江織物	2,700	3,075.00	8,302,500
アツギ	7,900	1,286.00	10,159,400
ダイニック	4,000	1,189.00	4,756,000
セーレン	17,900	2,103.00	37,643,700
小松精練	12,600	901.00	11,352,600
ワコールホールディングス	21,900	3,480.00	76,212,000
ホギメディカル	4,900	8,090.00	39,641,000
レナウン	26,700	177.00	4,725,900
T S Iホールディングス	29,600	852.00	25,219,200
三陽商会	4,900	2,113.00	10,353,700
オンワードホールディングス	48,000	916.00	43,968,000
ルック	16,000	380.00	6,080,000
ゴールドウイン	2,300	8,200.00	18,860,000
デサント	17,800	1,656.00	29,476,800
特種東海製紙	4,700	4,020.00	18,894,000
王子ホールディングス	326,000	683.00	222,658,000
日本製紙	34,500	2,154.00	74,313,000
三菱製紙	12,200	708.00	8,637,600
北越紀州製紙	42,000	630.00	26,460,000
中越パルプ工業	3,700	2,077.00	7,684,900
巴川製紙所	17,000	303.00	5,151,000
大王製紙	29,900	1,501.00	44,879,900
レンゴー	75,000	729.00	54,675,000

トーマック	5,300	2,108.00	11,172,400
ザ・パック	5,500	3,770.00	20,735,000
クラレ	130,700	2,161.00	282,442,700
旭化成	485,100	1,405.00	681,565,500
共和レザー	6,300	988.00	6,224,400
昭和電工	51,800	4,165.00	215,747,000
住友化学	572,000	782.00	447,304,000
住友精化	3,200	6,470.00	20,704,000
日産化学工業	45,100	4,500.00	202,950,000
ラサ工業	3,400	2,302.00	7,826,800
クレハ	6,200	7,400.00	45,880,000
テイカ	6,100	2,939.00	17,927,900
石原産業	14,300	2,046.00	29,257,800
日東エフシー	6,500	793.00	5,154,500
日本曹達	52,000	746.00	38,792,000
東ソー	112,100	2,479.00	277,895,900
トクヤマ	22,700	3,435.00	77,974,500
セントラル硝子	16,000	2,495.00	39,920,000
東亜合成	46,000	1,443.00	66,378,000
大阪ソーダ	7,000	2,861.00	20,027,000
関東電化工業	18,600	1,275.00	23,715,000
デンカ	28,600	4,130.00	118,118,000
信越化学工業	129,500	11,765.00	1,523,567,500
日本カーバイド工業	3,200	2,071.00	6,627,200
堺化学工業	5,500	2,532.00	13,926,000
エア・ウォーター	63,900	2,408.00	153,871,200
大陽日酸	59,400	1,541.00	91,535,400
日本化学工業	3,300	2,534.00	8,362,200
日本パーカライズン	40,000	1,861.00	74,440,000
高压ガス工業	13,500	947.00	12,784,500
チタン工業	1,200	2,564.00	3,076,800
四国化成工業	11,300	1,841.00	20,803,300
戸田工業	1,700	4,230.00	7,191,000
ステラ ケミファ	4,200	3,730.00	15,666,000
保土谷化学工業	2,600	6,610.00	17,186,000
日本触媒	12,300	7,830.00	96,309,000
大日精化工業	5,900	5,380.00	31,742,000
カネカ	105,000	992.00	104,160,000
三菱瓦斯化学	66,600	3,140.00	209,124,000
三井化学	70,500	3,625.00	255,562,500
J S R	78,100	2,151.00	167,993,100
東京応化工業	13,700	4,705.00	64,458,500

大阪有機化学工業	6,200	1,321.00	8,190,200
三菱ケミカルホールディングス	520,400	1,216.00	632,806,400
KHネオケム	12,100	2,684.00	32,476,400
ダイセル	105,200	1,331.00	140,021,200
住友ベークライト	63,000	916.00	57,708,000
積水化学工業	161,300	2,171.00	350,182,300
日本ゼオン	65,900	1,553.00	102,342,700
アイカ工業	21,800	3,935.00	85,783,000
宇部興産	39,200	3,255.00	127,596,000
積水樹脂	11,900	2,307.00	27,453,300
タキロンシーアイ	17,000	814.00	13,838,000
旭有機材	5,400	1,839.00	9,930,600
日立化成	38,200	2,953.00	112,804,600
ニチバン	4,200	2,963.00	12,444,600
リケンテクノス	18,300	630.00	11,529,000
大倉工業	19,000	679.00	12,901,000
積水化成成品工業	10,000	1,417.00	14,170,000
群栄化学工業	2,300	3,745.00	8,613,500
ミライアル	3,400	1,798.00	6,113,200
ダイキョーニシカワ	15,300	1,881.00	28,779,300
日本化薬	50,500	1,702.00	85,951,000
カーリットホールディングス	8,900	1,100.00	9,790,000
日本精化	8,000	1,125.00	9,000,000
扶桑化学工業	5,500	3,360.00	18,480,000
ADEKA	34,000	1,896.00	64,464,000
日油	30,200	3,090.00	93,318,000
新日本理化	12,100	262.00	3,170,200
ハリマ化成グループ	8,000	869.00	6,952,000
花王	182,600	7,438.00	1,358,178,800
第一工業製薬	15,000	812.00	12,180,000
三洋化成工業	4,800	5,920.00	28,416,000
大日本塗料	9,400	1,881.00	17,681,400
日本ペイントホールディングス	59,800	3,450.00	206,310,000
関西ペイント	81,500	2,949.00	240,343,500
中国塗料	22,800	969.00	22,093,200
日本特殊塗料	5,200	2,281.00	11,861,200
藤倉化成	12,300	691.00	8,499,300
太陽ホールディングス	5,900	5,140.00	30,326,000
DIC	30,600	4,175.00	127,755,000
サカタインクス	15,700	1,945.00	30,536,500
東洋インキSCホールディングス	74,000	650.00	48,100,000
T&K TOKA	6,500	1,346.00	8,749,000

富士フィルムホールディングス	154,100	4,582.00	706,086,200
資生堂	138,400	5,472.00	757,324,800
ライオン	103,400	2,094.00	216,519,600
高砂香料工業	4,900	3,545.00	17,370,500
マンダム	14,100	3,795.00	53,509,500
ミルボン	4,900	8,090.00	39,641,000
ファンケル	17,900	3,215.00	57,548,500
コーセー	12,500	17,220.00	215,250,000
シーズ・ホールディングス	10,100	4,715.00	47,621,500
ポーラ・オルビスホールディングス	31,700	4,100.00	129,970,000
ノエビアホールディングス	4,700	7,990.00	37,553,000
エステー	5,700	2,995.00	17,071,500
アグロ カネショウ	3,700	2,065.00	7,640,500
コニシ	12,200	2,033.00	24,802,600
長谷川香料	9,800	2,286.00	22,402,800
星光PMC	5,000	1,204.00	6,020,000
小林製薬	20,700	7,090.00	146,763,000
荒川化学工業	6,900	2,454.00	16,932,600
メック	5,400	2,414.00	13,035,600
日本高純度化学	2,700	2,657.00	7,173,900
タカラバイオ	19,400	1,492.00	28,944,800
JCU	4,600	5,720.00	26,312,000
新田ゼラチン	7,400	772.00	5,712,800
デクセリアルズ	19,500	1,364.00	26,598,000
アース製薬	5,500	5,790.00	31,845,000
北興化学工業	10,000	718.00	7,180,000
大成ラミック	2,800	3,065.00	8,582,000
クミアイ化学工業	33,600	780.00	26,208,000
日本農薬	21,300	693.00	14,760,900
アキレス	6,300	2,426.00	15,283,800
有沢製作所	13,000	1,260.00	16,380,000
日東電工	56,100	11,030.00	618,783,000
レック	4,700	2,724.00	12,802,800
きもと	19,000	296.00	5,624,000
藤森工業	6,100	3,955.00	24,125,500
前澤化成工業	5,700	1,226.00	6,988,200
JSP	4,200	3,785.00	15,897,000
エフピコ	6,000	6,230.00	37,380,000
天馬	5,900	2,105.00	12,419,500
信越ポリマー	15,200	1,184.00	17,996,800
東リ	22,500	406.00	9,135,000
ニフコ	13,600	7,530.00	102,408,000

日本バルカー工業	6,200	2,649.00	16,423,800
ユニ・チャーム	157,700	2,943.00	464,111,100
協和発酵キリン	92,500	2,129.00	196,932,500
武田薬品工業	273,500	6,184.00	1,691,324,000
アステラス製薬	763,100	1,426.00	1,088,180,600
大日本住友製薬	54,900	1,628.00	89,377,200
塩野義製薬	106,300	6,259.00	665,331,700
田辺三菱製薬	90,000	2,427.00	218,430,000
あすか製薬	8,700	2,044.00	17,782,800
日本新薬	19,400	8,040.00	155,976,000
中外製薬	77,300	5,810.00	449,113,000
科研製薬	13,500	5,620.00	75,870,000
エーザイ	88,900	6,371.00	566,381,900
ロート製薬	41,100	2,879.00	118,326,900
小野薬品工業	190,300	2,559.00	486,977,700
久光製薬	22,000	6,320.00	139,040,000
持田製薬	5,300	8,120.00	43,036,000
参天製薬	140,300	1,712.00	240,193,600
扶桑薬品工業	3,500	2,822.00	9,877,000
日本ケミファ	1,400	4,975.00	6,965,000
ツムラ	26,700	3,880.00	103,596,000
日医工	19,400	1,688.00	32,747,200
キッセイ薬品工業	14,000	3,205.00	44,870,000
生化学工業	14,700	1,627.00	23,916,900
栄研化学	6,100	5,150.00	31,415,000
鳥居薬品	4,700	2,963.00	13,926,100
JCRファーマ	5,300	4,660.00	24,698,000
東和薬品	3,700	5,830.00	21,571,000
富士製薬工業	2,800	4,345.00	12,166,000
沢井製薬	13,300	5,490.00	73,017,000
ゼリア新薬工業	16,000	2,170.00	34,720,000
第一三共	212,500	2,708.00	575,450,000
キョーリン製薬ホールディングス	21,000	2,143.00	45,003,000
大幸薬品	4,400	2,513.00	11,057,200
ダイト	5,200	3,105.00	16,146,000
大塚ホールディングス	154,300	4,974.00	767,488,200
大正製薬ホールディングス	16,500	8,920.00	147,180,000
ペプチドリーム	30,700	3,745.00	114,971,500
日本コークス工業	69,000	123.00	8,487,000
昭和シェル石油	69,300	1,432.00	99,237,600
ニチレキ	10,000	1,358.00	13,580,000
ユシロ化学工業	4,500	1,603.00	7,213,500

ビーピー・カストロール	3,500	2,176.00	7,616,000	
富士石油	19,500	550.00	10,725,000	
MORESCO	3,000	2,082.00	6,246,000	
出光興産	62,200	3,770.00	234,494,000	
JXTGホールディングス	1,185,400	630.00	746,802,000	
コスモエネルギーホールディングス	20,700	3,375.00	69,862,500	
横浜ゴム	43,300	2,516.00	108,942,800	
東洋ゴム工業	44,400	2,290.00	101,676,000	
ブリヂストン	262,400	5,095.00	1,336,928,000	
住友ゴム工業	71,800	2,040.00	146,472,000	
藤倉ゴム工業	7,000	1,013.00	7,091,000	
オカモト	27,000	1,142.00	30,834,000	
ニッタ	7,600	4,395.00	33,402,000	
住友理工	14,800	1,181.00	17,478,800	
三ツ星ベルト	19,000	1,464.00	27,816,000	
バンドー化学	15,300	1,273.00	19,476,900	
日東紡績	11,300	3,370.00	38,081,000	
旭硝子	75,900	4,680.00	355,212,000	
日本板硝子	26,900	993.00	26,711,700	
日本山村硝子	47,000	189.00	8,883,000	
日本電気硝子	32,500	4,360.00	141,700,000	
オハラ	3,400	2,846.00	9,676,400	
住友大阪セメント	149,000	526.00	78,374,000	
太平洋セメント	46,900	4,610.00	216,209,000	
日本ヒューム	10,500	779.00	8,179,500	
日本コンクリート工業	20,600	503.00	10,361,800	
三谷セキサン	4,400	2,699.00	11,875,600	
アジアパイルホールディングス	12,300	812.00	9,987,600	
東海カーボン	67,500	1,187.00	80,122,500	
日本カーボン	4,100	4,385.00	17,978,500	
東洋炭素	5,100	3,590.00	18,309,000	
ノリタケカンパニーリミテド	4,700	5,170.00	24,299,000	
TOTO	57,200	6,240.00	356,928,000	
日本碍子	90,700	2,145.00	194,551,500	
日本特殊陶業	63,900	2,586.00	165,245,400	
MARUWA	2,700	7,120.00	19,224,000	
品川リフラクトリーズ	2,500	3,390.00	8,475,000	
黒崎播磨	1,900	4,640.00	8,816,000	
フジインコーポレーテッド	7,000	2,563.00	17,941,000	
ニチアス	41,000	1,445.00	59,245,000	
ニチハ	11,300	4,360.00	49,268,000	
新日鐵住金	328,600	2,721.00	894,120,600	

神戸製鋼所	134,700	1,053.00	141,839,100
中山製鋼所	10,000	719.00	7,190,000
合同製鐵	4,700	2,168.00	10,189,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	198,400	2,642.00	524,172,800
日新製鋼	20,500	1,730.00	35,465,000
東京製鐵	39,000	974.00	37,986,000
共英製鋼	8,400	2,004.00	16,833,600
大和工業	15,800	3,040.00	48,032,000
東京鐵鋼	4,100	1,931.00	7,917,100
大阪製鐵	5,100	2,361.00	12,041,100
淀川製鋼所	10,500	3,340.00	35,070,000
東洋鋼鈹	19,900	458.00	9,114,200
丸一鋼管	26,200	3,170.00	83,054,000
モリ工業	2,900	3,495.00	10,135,500
大同特殊鋼	13,100	6,790.00	88,949,000
日本冶金工業	63,700	222.00	14,141,400
山陽特殊製鋼	8,500	2,850.00	24,225,000
愛知製鋼	4,000	4,395.00	17,580,000
日立金属	78,800	1,485.00	117,018,000
日本金属	2,200	2,539.00	5,585,800
大平洋金属	4,700	2,937.00	13,803,900
新日本電工	44,800	444.00	19,891,200
栗本鐵工所	4,400	2,292.00	10,084,800
三菱製鋼	5,400	2,699.00	14,574,600
日本精線	1,300	5,530.00	7,189,000
シンニッタン	8,800	758.00	6,670,400
大紀アルミニウム工業所	13,100	795.00	10,414,500
日本輕金属ホールディングス	217,000	300.00	65,100,000
三井金属鈹業	20,000	6,340.00	126,800,000
東邦亜鉛	4,200	5,780.00	24,276,000
三菱マテリアル	48,600	3,750.00	182,250,000
住友金属鈹山	94,300	4,355.00	410,676,500
D O W A ホールディングス	18,900	4,270.00	80,703,000
古河機械金属	12,400	2,262.00	28,048,800
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,500	1,860.00	15,810,000
東邦チタニウム	14,600	1,015.00	14,819,000
U A C J	11,300	2,910.00	32,883,000
古河電氣工業	24,600	5,940.00	146,124,000
住友電氣工業	275,500	1,958.50	539,566,750
フジクラ	89,900	1,047.00	94,125,300
タツタ電線	16,100	852.00	13,717,200
平河ヒューテック	5,000	1,302.00	6,510,000

リョービ	9,300	2,906.00	27,025,800
アーレスティ	10,600	921.00	9,762,600
アサヒホールディングス	12,200	1,981.00	24,168,200
稲葉製作所	5,100	1,424.00	7,262,400
宮地エンジニアリンググループ	2,600	2,622.00	6,817,200
トーカロ	5,200	4,755.00	24,726,000
アルファC o	3,300	2,299.00	7,586,700
SUMCO	67,700	2,823.00	191,117,100
川田テクノロジーズ	1,600	6,240.00	9,984,000
RS Technologies	1,300	3,965.00	5,154,500
東洋製罐グループホールディングス	49,900	1,851.00	92,364,900
ホッカンホールディングス	25,000	458.00	11,450,000
コロナ	5,300	1,423.00	7,541,900
横河ブリッジホールディングス	13,800	2,375.00	32,775,000
駒井ハルテック	2,700	2,699.00	7,287,300
三和ホールディングス	70,500	1,481.00	104,410,500
文化シャッター	22,200	1,165.00	25,863,000
三協立山	10,600	1,586.00	16,811,600
アルインコ	7,500	1,235.00	9,262,500
LIXILグループ	107,900	2,955.00	318,844,500
日本フィルコン	7,300	747.00	5,453,100
ノーリツ	16,600	2,173.00	36,071,800
長府製作所	8,300	2,693.00	22,351,900
リンナイ	13,100	10,070.00	131,917,000
日東精工	12,800	660.00	8,448,000
岡部	16,100	1,053.00	16,953,300
ジーテクト	8,300	2,366.00	19,637,800
東プレ	13,400	3,220.00	43,148,000
高周波熱錬	15,000	1,170.00	17,550,000
東京製綱	6,300	1,606.00	10,117,800
パイオラックス	10,800	3,430.00	37,044,000
エイチワン	6,100	1,595.00	9,729,500
日本発條	73,600	1,250.00	92,000,000
三益半導体工業	6,800	2,070.00	14,076,000
日本製綱所	24,300	3,600.00	87,480,000
三浦工業	32,100	2,872.00	92,191,200
タクマ	24,900	1,631.00	40,611,900
ツガミ	20,000	1,169.00	23,380,000
オークマ	8,600	7,160.00	61,576,000
東芝機械	41,000	793.00	32,513,000
アマダホールディングス	112,500	1,491.00	167,737,500
アイダエンジニアリング	18,600	1,365.00	25,389,000

滝澤鉄工所	3,200	2,125.00	6,800,000
富士機械製造	21,500	2,187.00	47,020,500
牧野フライス製作所	35,000	1,113.00	38,955,000
オーエスジー	33,800	2,296.00	77,604,800
旭ダイヤモンド工業	22,000	1,211.00	26,642,000
D M G 森精機	40,600	2,247.00	91,228,200
ソディック	16,100	1,482.00	23,860,200
ディスコ	9,900	24,860.00	246,114,000
日東工器	5,100	2,836.00	14,463,600
パンチ工業	3,500	2,446.00	8,561,000
豊和工業	4,300	1,550.00	6,665,000
O K K	4,400	1,259.00	5,539,600
石川製作所	2,100	2,930.00	6,153,000
東洋機械金属	6,800	864.00	5,875,200
津田駒工業	27,000	192.00	5,184,000
島精機製作所	9,200	7,220.00	66,424,000
フリュー	6,500	1,068.00	6,942,000
ヤマシンフィルタ	10,500	1,375.00	14,437,500
日阪製作所	12,600	1,181.00	14,880,600
やまびこ	14,500	1,694.00	24,563,000
平田機工	2,000	12,370.00	24,740,000
ペガサスミシン製造	9,000	773.00	6,957,000
ナプテスコ	40,300	4,385.00	176,715,500
三井海洋開発	7,800	2,690.00	20,982,000
レオン自動機	6,900	1,699.00	11,723,100
S M C	23,300	45,470.00	1,059,451,000
新川	7,800	1,015.00	7,917,000
ホソカワミクロン	2,800	7,350.00	20,580,000
ユニオンツール	3,400	4,205.00	14,297,000
オイレス工業	9,600	2,373.00	22,780,800
日精エー・エス・ビー機械	2,500	6,470.00	16,175,000
サトーホールディングス	9,700	3,150.00	30,555,000
技研製作所	3,900	3,100.00	12,090,000
日精樹脂工業	7,000	1,711.00	11,977,000
オカダアイヨン	2,700	2,108.00	5,691,600
ワイエイシイホールディングス	3,900	1,061.00	4,137,900
小松製作所	358,600	3,480.00	1,247,928,000
住友重機械工業	42,300	4,565.00	193,099,500
日立建機	34,400	3,715.00	127,796,000
日工	3,000	2,281.00	6,843,000
巴工業	4,100	2,166.00	8,880,600
井関農機	7,500	2,743.00	20,572,500

T O W A	6,200	2,241.00	13,894,200
北川鉄工所	4,300	2,903.00	12,482,900
ローツェ	3,800	2,681.00	10,187,800
クボタ	400,500	2,120.00	849,060,000
三菱化工機	3,000	2,298.00	6,894,000
月島機械	15,000	1,250.00	18,750,000
帝国電機製作所	7,000	1,443.00	10,101,000
新東工業	17,900	1,375.00	24,612,500
澁谷工業	6,600	4,125.00	27,225,000
アイチ コーポレーション	13,100	797.00	10,440,700
小森コーポレーション	18,700	1,573.00	29,415,100
鶴見製作所	6,400	1,820.00	11,648,000
住友精密工業	18,000	375.00	6,750,000
酒井重工業	2,000	4,305.00	8,610,000
荏原製作所	30,500	4,385.00	133,742,500
西島製作所	9,300	1,136.00	10,564,800
北越工業	9,300	1,191.00	11,076,300
ダイキン工業	101,300	12,920.00	1,308,796,000
オルガノ	3,300	2,931.00	9,672,300
トーヨーカネツ	3,400	4,190.00	14,246,000
栗田工業	40,200	3,515.00	141,303,000
椿本チエイン	43,000	891.00	38,313,000
大同工業	4,000	1,687.00	6,748,000
アネスト岩田	13,500	1,223.00	16,510,500
ダイフク	36,900	6,120.00	225,828,000
加藤製作所	3,700	3,095.00	11,451,500
タダノ	36,100	1,706.00	61,586,600
フジテック	22,600	1,699.00	38,397,400
C K D	20,400	2,439.00	49,755,600
キトー	6,300	1,712.00	10,785,600
平和	22,700	1,938.00	43,992,600
理想科学工業	7,200	2,143.00	15,429,600
S A N K Y O	18,900	3,625.00	68,512,500
日本金銭機械	7,900	1,129.00	8,919,100
マースエンジニアリング	4,900	2,356.00	11,544,400
福島工業	4,600	5,250.00	24,150,000
ダイコク電機	4,100	1,844.00	7,560,400
竹内製作所	12,300	2,365.00	29,089,500
アマノ	22,800	2,932.00	66,849,600
J U K I	11,100	1,953.00	21,678,300
サンデンホールディングス	9,200	2,123.00	19,531,600
蛇の目マシン工業	9,300	905.00	8,416,500

マックス	11,600	1,573.00	18,246,800
グローリー	22,400	3,990.00	89,376,000
新晃工業	8,000	2,203.00	17,624,000
大和冷機工業	12,000	1,251.00	15,012,000
セガサミーホールディングス	73,800	1,358.00	100,220,400
日本ピストンリング	3,800	2,246.00	8,534,800
リケン	3,500	6,040.00	21,140,000
T P R	8,200	3,835.00	31,447,000
ツバキ・ナカシマ	7,500	2,498.00	18,735,000
ホシザキ	23,400	10,690.00	250,146,000
大豊工業	6,500	1,730.00	11,245,000
日本精工	151,200	1,691.00	255,679,200
N T N	170,800	551.00	94,110,800
ジェイテクト	78,300	1,929.00	151,040,700
不二越	71,000	706.00	50,126,000
日本トムソン	25,000	734.00	18,350,000
T H K	46,200	4,105.00	189,651,000
ユーシン精機	3,600	3,340.00	12,024,000
イーグル工業	8,300	2,027.00	16,824,100
日本ピラー工業	8,400	1,554.00	13,053,600
キッツ	33,400	829.00	27,688,600
マキタ	96,400	4,640.00	447,296,000
日立造船	57,900	582.00	33,697,800
三菱重工業	124,600	4,150.00	517,090,000
I H I	57,100	3,465.00	197,851,500
スター精密	12,000	1,839.00	22,068,000
日清紡ホールディングス	45,700	1,572.00	71,840,400
イビデン	45,800	1,787.00	81,844,600
コニカミノルタ	173,100	1,096.00	189,717,600
ブラザー工業	90,600	2,776.00	251,505,600
ミネベアミツミ	137,500	2,215.00	304,562,500
日立製作所	1,783,000	834.20	1,487,378,600
三菱電機	742,200	1,852.50	1,374,925,500
富士電機	223,000	792.00	176,616,000
東洋電機製造	4,000	1,854.00	7,416,000
安川電機	85,800	4,950.00	424,710,000
シンフォニアテクノロジー	49,000	433.00	21,217,000
明電舎	64,000	464.00	29,696,000
オリジン電気	2,700	1,731.00	4,673,700
山洋電気	3,600	8,150.00	29,340,000
デンヨー	7,400	1,936.00	14,326,400
東芝テック	52,000	708.00	36,816,000

芝浦メカトロニクス	13,000	474.00	6,162,000
マブチモーター	20,600	5,980.00	123,188,000
日本電産	89,300	15,270.00	1,363,611,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,100	2,579.00	7,994,900
東光高岳	4,500	1,841.00	8,284,500
ダブル・スコープ	11,200	2,226.00	24,931,200
ダイヘン	40,000	1,004.00	40,160,000
ヤーマン	9,900	2,037.00	20,166,300
JVCケンウッド	56,000	345.00	19,320,000
ミマキエンジニアリング	7,600	1,023.00	7,774,800
第一精工	3,900	2,991.00	11,664,900
日新電機	17,400	1,352.00	23,524,800
大崎電気工業	16,800	794.00	13,339,200
オムロン	78,600	6,630.00	521,118,000
日東工業	11,100	1,849.00	20,523,900
I D E C	9,600	2,854.00	27,398,400
ジーエス・ユアサ コーポレーション	134,000	580.00	77,720,000
サクサホールディングス	2,400	2,037.00	4,888,800
メルコホールディングス	3,900	3,695.00	14,410,500
日本電気	95,900	3,000.00	287,700,000
富士通	763,000	834.90	637,028,700
沖電気工業	30,500	1,617.00	49,318,500
電気興業	4,900	2,890.00	14,161,000
サンケン電気	44,000	671.00	29,524,000
アイホン	5,200	1,917.00	9,968,400
ルネサスエレクトロニクス	37,800	1,373.00	51,899,400
セイコーエプソン	109,800	2,720.00	298,656,000
ワコム	58,700	607.00	35,630,900
アルバック	12,500	7,530.00	94,125,000
E I Z O	6,800	4,785.00	32,538,000
ジャパンディスプレイ	108,100	199.00	21,511,900
日本信号	21,000	1,208.00	25,368,000
京三製作所	20,000	624.00	12,480,000
能美防災	9,400	2,084.00	19,589,600
ホーチキ	5,600	2,555.00	14,308,000
エレコム	6,700	2,553.00	17,105,100
パナソニック	848,400	1,668.00	1,415,131,200
アンリツ	54,700	1,070.00	58,529,000
富士通ゼネラル	22,900	2,381.00	54,524,900
日立国際電気	14,300	3,190.00	45,617,000
ソニー	495,700	5,201.00	2,578,135,700
T D K	38,700	9,170.00	354,879,000

タムラ製作所	29,100	809.00	23,541,900
アルプス電気	63,500	3,575.00	227,012,500
池上通信機	34,000	181.00	6,154,000
パイオニア	120,000	218.00	26,160,000
日本電波工業	9,500	784.00	7,448,000
日本トリム	1,900	5,540.00	10,526,000
ローランド ディー・ジー	4,200	3,180.00	13,356,000
フォスター電機	8,900	2,935.00	26,121,500
クラリオン	39,000	436.00	17,004,000
SMK	21,000	514.00	10,794,000
ヨコオ	5,700	1,434.00	8,173,800
ホシデン	18,900	1,769.00	33,434,100
ヒロセ電機	12,000	16,740.00	200,880,000
日本航空電子工業	19,000	2,015.00	38,285,000
TOA	8,700	1,383.00	12,032,100
マクセルホールディングス	14,500	2,290.00	33,205,000
古野電気	10,800	819.00	8,845,200
ユニデンホールディングス	25,000	303.00	7,575,000
アルパイン	18,000	2,591.00	46,638,000
スミダコーポレーション	8,000	1,982.00	15,856,000
アイコム	4,800	2,524.00	12,115,200
リオン	3,600	2,377.00	8,557,200
本多通信工業	6,400	1,163.00	7,443,200
船井電機	9,200	863.00	7,939,600
横河電機	74,300	2,070.00	153,801,000
新電元工業	2,700	7,770.00	20,979,000
アズビル	22,300	4,860.00	108,378,000
日本光電工業	31,300	2,575.00	80,597,500
チノー	4,000	1,573.00	6,292,000
共和電業	13,000	456.00	5,928,000
堀場製作所	14,800	7,000.00	103,600,000
アドバンテスト	41,600	2,235.00	92,976,000
エスベック	6,700	2,755.00	18,458,500
キーエンス	36,400	64,910.00	2,362,724,000
日置電機	4,700	2,564.00	12,050,800
シスメックス	57,600	8,520.00	490,752,000
日本マイクロニクス	13,200	1,088.00	14,361,600
メガチップス	6,100	3,415.00	20,831,500
OBARA GROUP	4,300	7,880.00	33,884,000
澤藤電機	1,200	2,377.00	2,852,400
コーセル	10,700	1,555.00	16,638,500
イリソ電子工業	6,200	6,670.00	41,354,000

新日本無線	5,500	847.00	4,658,500
オブテックスグループ	6,200	4,815.00	29,853,000
千代田インテグレ	3,900	2,699.00	10,526,100
アイ・オー・データ機器	4,300	1,009.00	4,338,700
レーザーテック	16,400	2,730.00	44,772,000
スタンレー電気	56,700	4,485.00	254,299,500
岩崎電気	3,500	1,685.00	5,897,500
ウシオ電機	45,300	1,618.00	73,295,400
ハリオス テクノ ホールディング	7,200	1,100.00	7,920,000
日本セラミック	7,700	3,045.00	23,446,500
遠藤照明	5,300	1,271.00	6,736,300
古河電池	5,900	1,063.00	6,271,700
双信電機	3,700	804.00	2,974,800
山一電機	5,600	2,130.00	11,928,000
図研	5,500	1,835.00	10,092,500
日本電子	28,000	656.00	18,368,000
カシオ計算機	60,000	1,642.00	98,520,000
ファナック	70,600	27,945.00	1,972,917,000
日本シイエムケイ	13,800	1,061.00	14,641,800
エンプラス	3,500	4,635.00	16,222,500
大真空	3,700	1,676.00	6,201,200
ローム	33,200	11,500.00	381,800,000
浜松ホトニクス	54,000	3,850.00	207,900,000
三井ハイテック	10,000	2,342.00	23,420,000
新光電気工業	28,200	860.00	24,252,000
京セラ	121,900	7,901.00	963,131,900
太陽誘電	33,700	1,876.00	63,221,200
村田製作所	77,900	15,165.00	1,181,353,500
ユーシン	13,400	768.00	10,291,200
双葉電子工業	12,200	2,337.00	28,511,400
北陸電気工業	4,100	1,823.00	7,474,300
ニチコン	23,300	1,486.00	34,623,800
日本ケミコン	6,100	3,745.00	22,844,500
K O A	10,500	2,271.00	23,845,500
市光工業	11,500	1,090.00	12,535,000
小糸製作所	44,200	7,750.00	342,550,000
ミツバ	13,800	1,532.00	21,141,600
S C R E E Nホールディングス	14,100	10,060.00	141,846,000
キャノン電子	6,800	2,480.00	16,864,000
キャノン	399,800	4,298.00	1,718,340,400
リコー	222,800	996.00	221,908,800
東京エレクトロン	49,500	20,760.00	1,027,620,000

トヨタ紡織	21,800	2,326.00	50,706,800	
芦森工業	1,900	3,015.00	5,728,500	
ユニプレス	14,400	2,972.00	42,796,800	
豊田自動織機	59,800	6,970.00	416,806,000	
モリタホールディングス	12,000	2,090.00	25,080,000	
三櫻工業	11,700	842.00	9,851,400	
デンソー	164,800	6,305.00	1,039,064,000	
東海理化電機製作所	19,600	2,333.00	45,726,800	
三井造船	26,900	1,627.00	43,766,300	
川崎重工業	57,400	3,710.00	212,954,000	
名村造船所	23,300	687.00	16,007,100	
日本車輛製造	33,000	350.00	11,550,000	
三菱ロジスネクスト	9,800	944.00	9,251,200	
日産自動車	875,900	1,088.00	952,979,200	
いすゞ自動車	215,500	1,771.00	381,650,500	
トヨタ自動車	902,900	7,044.00	6,360,027,600	代用有価証券 500,000株
日野自動車	105,700	1,374.00	145,231,800	
三菱自動車工業	274,600	785.00	215,561,000	
エフテック	5,500	1,852.00	10,186,000	
武蔵精密工業	8,000	3,375.00	27,000,000	
日産車体	29,000	1,147.00	33,263,000	
新明和工業	31,300	1,077.00	33,710,100	
極東開発工業	14,000	1,933.00	27,062,000	
日信工業	14,800	2,193.00	32,456,400	
トピー工業	6,200	3,405.00	21,111,000	
ティラド	3,200	3,870.00	12,384,000	
曙ブレーキ工業	36,700	342.00	12,551,400	
タチエス	13,000	2,103.00	27,339,000	
N O K	40,100	2,732.00	109,553,200	
フタバ産業	23,200	1,048.00	24,313,600	
K Y B	7,800	6,620.00	51,636,000	
大同メタル工業	11,700	1,004.00	11,746,800	
プレス工業	40,200	669.00	26,893,800	
ミクニ	12,700	675.00	8,572,500	
太平洋工業	15,900	1,613.00	25,646,700	
ケーヒン	17,000	2,204.00	37,468,000	
河西工業	9,400	1,957.00	18,395,800	
アイシン精機	60,800	6,010.00	365,408,000	
マツダ	233,200	1,503.00	350,499,600	
今仙電機製作所	8,500	1,336.00	11,356,000	
本田技研工業	668,300	3,744.00	2,502,115,200	
スズキ	147,200	6,040.00	889,088,000	

S U B A R U	230,500	3,669.00	845,704,500
安永	3,700	2,662.00	9,849,400
ヤマハ発動機	104,300	3,520.00	367,136,000
ショーワ	19,600	1,363.00	26,714,800
T B K	14,500	532.00	7,714,000
エクセディ	8,800	3,345.00	29,436,000
豊田合成	27,100	2,807.00	76,069,700
愛三工業	13,600	1,279.00	17,394,400
ヨロズ	7,500	2,484.00	18,630,000
エフ・シー・シー	12,300	2,837.00	34,895,100
シマノ	29,900	15,520.00	464,048,000
テイ・エス テック	17,300	4,595.00	79,493,500
ジャムコ	3,900	2,890.00	11,271,000
テルモ	113,800	5,380.00	612,244,000
日機装	26,900	1,107.00	29,778,300
島津製作所	88,500	2,677.00	236,914,500
J M S	11,500	631.00	7,256,500
長野計器	6,800	1,349.00	9,173,200
ブイ・テクノロジー	1,700	18,730.00	31,841,000
東京計器	5,700	1,390.00	7,923,000
東京精密	13,400	4,655.00	62,377,000
マニー	9,300	3,220.00	29,946,000
ニコン	129,200	2,227.00	287,728,400
トプコン	40,200	2,491.00	100,138,200
オリンパス	110,500	4,610.00	509,405,000
理研計器	7,200	2,525.00	18,180,000
タムロン	6,400	2,433.00	15,571,200
H O Y A	152,900	5,448.00	832,999,200
ノーリツ鋼機	7,800	2,132.00	16,629,600
シチズン時計	90,000	815.00	73,350,000
リズム時計工業	4,000	2,360.00	9,440,000
大研医器	10,000	765.00	7,650,000
メニコン	5,200	5,850.00	30,420,000
松風	6,200	1,409.00	8,735,800
セイコーホールディングス	10,900	3,045.00	33,190,500
ニプロ	52,400	1,624.00	85,097,600
スノーピーク	3,000	1,483.00	4,449,000
パラマウントベッドホールディングス	7,800	5,330.00	41,574,000
トランザクション	4,000	1,068.00	4,272,000
ニホンフラッシュ	4,100	2,378.00	9,749,800
前田工織	7,500	1,994.00	14,955,000
永大産業	14,000	560.00	7,840,000

アートネイチャー	11,000	807.00	8,877,000
ダンロップスポーツ	6,300	1,589.00	10,010,700
バンダイナムコホールディングス	76,600	3,650.00	279,590,000
SHOEI	3,500	4,270.00	14,945,000
フランスベッドホールディングス	11,100	1,059.00	11,754,900
パイロットコーポレーション	13,000	5,410.00	70,330,000
萩原工業	5,000	1,975.00	9,875,000
トッパン・フォームズ	13,800	1,220.00	16,836,000
フジシールインターナショナル	16,400	3,820.00	62,648,000
タカラトミー	31,000	1,599.00	49,569,000
アーク	40,900	124.00	5,071,600
プロネクサス	8,500	1,351.00	11,483,500
大建工業	5,800	2,878.00	16,692,400
凸版印刷	208,000	1,046.00	217,568,000
大日本印刷	96,800	2,455.00	237,644,000
図書印刷	5,700	1,013.00	5,774,100
共同印刷	2,500	3,580.00	8,950,000
NISSHA	14,700	3,615.00	53,140,500
宝印刷	5,300	1,742.00	9,232,600
アシックス	73,800	1,656.00	122,212,800
ツツミ	3,100	2,159.00	6,692,900
小松ウオール工業	3,400	2,308.00	7,847,200
ヤマハ	49,900	4,130.00	206,087,000
河合楽器製作所	3,300	2,529.00	8,345,700
クリナップ	8,800	858.00	7,550,400
ピジョン	44,900	4,295.00	192,845,500
キングジム	8,300	1,001.00	8,308,300
リンテック	17,600	3,090.00	54,384,000
イトーキ	16,900	836.00	14,128,400
任天堂	45,700	45,200.00	2,065,640,000
三菱鉛筆	12,000	2,433.00	29,196,000
タカラスタANDARD	15,100	1,787.00	26,983,700
コクヨ	35,600	2,130.00	75,828,000
ナカバヤシ	9,900	708.00	7,009,200
グローブライド	4,500	1,996.00	8,982,000
岡村製作所	25,700	1,472.00	37,830,400
美津濃	7,300	3,335.00	24,345,500
東京電力ホールディングス	591,400	450.00	266,130,000
中部電力	227,700	1,419.00	323,106,300
関西電力	303,400	1,484.00	450,245,600
中国電力	101,700	1,240.00	126,108,000
北陸電力	73,300	990.00	72,567,000

東北電力	173,000	1,482.00	256,386,000
四国電力	66,900	1,508.00	100,885,200
九州電力	162,800	1,283.00	208,872,400
北海道電力	74,800	807.00	60,363,600
沖縄電力	12,000	2,931.00	35,172,000
電源開発	59,200	3,120.00	184,704,000
エフオン	4,300	1,528.00	6,570,400
イーレックス	12,400	1,100.00	13,640,000
東京瓦斯	158,700	2,635.00	418,174,500
大阪瓦斯	144,500	2,157.00	311,686,500
東邦瓦斯	36,900	3,190.00	117,711,000
広島ガス	22,200	366.00	8,125,200
西部瓦斯	9,100	2,657.00	24,178,700
静岡ガス	21,300	974.00	20,746,200
メタウォーター	4,500	2,857.00	12,856,500
SBSホールディングス	8,700	994.00	8,647,800
東武鉄道	79,000	3,575.00	282,425,000
相鉄ホールディングス	24,500	2,923.00	71,613,500
東京急行電鉄	200,500	1,791.00	359,095,500
京浜急行電鉄	102,000	2,167.00	221,034,000
小田急電鉄	109,700	2,385.00	261,634,500
京王電鉄	41,300	4,960.00	204,848,000
京成電鉄	51,800	3,600.00	186,480,000
富士急行	10,400	3,070.00	31,928,000
東日本旅客鉄道	133,400	10,865.00	1,449,391,000
西日本旅客鉄道	67,100	8,257.00	554,044,700
東海旅客鉄道	66,500	20,775.00	1,381,537,500
西武ホールディングス	94,800	2,029.00	192,349,200
鴻池運輸	10,700	1,855.00	19,848,500
西日本鉄道	20,500	2,920.00	59,860,000
ハマキョウレックス	5,100	3,125.00	15,937,500
サカイ引越センター	3,900	5,670.00	22,113,000
近鉄グループホールディングス	69,900	4,395.00	307,210,500
阪急阪神ホールディングス	93,400	4,350.00	406,290,000
南海電気鉄道	33,600	2,803.00	94,180,800
京阪ホールディングス	31,800	3,325.00	105,735,000
神戸電鉄	2,500	3,810.00	9,525,000
名古屋鉄道	54,200	2,741.00	148,562,200
山陽電気鉄道	6,000	2,868.00	17,208,000
日本通運	27,500	7,130.00	196,075,000
ヤマトホールディングス	123,800	2,275.50	281,706,900
山九	18,300	4,780.00	87,474,000

丸全昭和運輸	29,000	500.00	14,500,000
センコーグループホールディングス	40,200	802.00	32,240,400
トナミホールディングス	1,800	4,795.00	8,631,000
ニッコンホールディングス	26,500	3,025.00	80,162,500
福山通運	10,100	4,040.00	40,804,000
セイノーホールディングス	52,700	1,773.00	93,437,100
神奈川中央交通	2,400	3,620.00	8,688,000
日立物流	14,800	2,793.00	41,336,400
丸和運輸機関	4,000	3,060.00	12,240,000
C & F ロジホールディングス	8,600	1,510.00	12,986,000
九州旅客鉄道	59,300	3,470.00	205,771,000
日本郵船	58,400	2,618.00	152,891,200
商船三井	44,200	3,600.00	159,120,000
川崎汽船	32,800	2,894.00	94,923,200
N S ユナイテッド海運	3,800	2,663.00	10,119,400
飯野海運	37,700	620.00	23,374,000
乾汽船	9,000	760.00	6,840,000
日本航空	130,800	4,116.00	538,372,800
A N A ホールディングス	138,100	4,480.00	618,688,000
トランコム	2,100	7,320.00	15,372,000
日新	6,300	3,095.00	19,498,500
三菱倉庫	24,300	3,000.00	72,900,000
三井倉庫ホールディングス	45,000	360.00	16,200,000
住友倉庫	51,000	796.00	40,596,000
澁澤倉庫	5,200	1,916.00	9,963,200
東陽倉庫	22,300	327.00	7,292,100
日本トランスシティ	22,000	459.00	10,098,000
川西倉庫	1,900	2,860.00	5,434,000
安田倉庫	8,700	891.00	7,751,700
東洋埠頭	3,500	1,832.00	6,412,000
上組	44,200	2,474.00	109,350,800
キューソー流通システム	2,400	3,190.00	7,656,000
郵船ロジスティクス	6,900	1,497.00	10,329,300
近鉄エクスプレス	13,000	2,223.00	28,899,000
エーアイティー	6,300	1,391.00	8,763,300
N E C ネットズエスアイ	8,000	2,928.00	23,424,000
システナ	6,000	3,995.00	23,970,000
デジタルアーツ	3,700	4,865.00	18,000,500
新日鉄住金ソリューションズ	11,200	2,902.00	32,502,400
キューブシステム	6,900	803.00	5,540,700
コア	3,800	1,620.00	6,156,000
ソフトクリエイイトホールディングス	5,000	1,571.00	7,855,000

T I S	24,500	3,820.00	93,590,000
電算システム	3,700	2,103.00	7,781,100
グリー	45,400	731.00	33,187,400
コーエーテクモホールディングス	12,400	2,307.00	28,606,800
三菱総合研究所	3,600	3,760.00	13,536,000
ファインデックス	8,000	758.00	6,064,000
ヒト・コミュニケーションズ	2,300	2,238.00	5,147,400
K L a b	14,500	1,898.00	27,521,000
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	6,100	1,829.00	11,156,900
ネクソン	81,600	3,220.00	262,752,000
アイスタイル	18,100	880.00	15,928,000
エムアップ	2,900	1,399.00	4,057,100
エイチーム	5,300	2,847.00	15,089,100
テクノスジャパン	7,300	959.00	7,000,700
コロプラ	24,000	1,156.00	27,744,000
ブロードリーフ	19,000	1,154.00	21,926,000
ハーツユナイテッドグループ	4,600	1,847.00	8,496,200
メディアドゥホールディングス	2,700	2,422.00	6,539,400
フィックスターズ	1,500	5,850.00	8,775,000
VOYAGE GROUP	4,300	1,422.00	6,114,600
オブティム	1,700	2,619.00	4,452,300
セレス	3,000	1,465.00	4,395,000
ティーガイア	7,200	2,452.00	17,654,400
日本アジアグループ	11,800	453.00	5,345,400
豆蔵ホールディングス	6,600	1,251.00	8,256,600
テクマトリックス	4,800	1,743.00	8,366,400
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	200,000	286.00	57,200,000
GMOペイメントゲートウェイ	5,200	8,260.00	42,952,000
インターネットイニシアティブ	11,900	2,188.00	26,037,200
さくらインターネット	9,900	833.00	8,246,700
GMOクラウド	2,000	2,457.00	4,914,000
SRAホールディングス	4,300	3,490.00	15,007,000
フリービット	6,400	936.00	5,990,400
コムチュア	4,400	2,499.00	10,995,600
メディカル・データ・ビジョン	3,300	2,098.00	6,923,400
g u m i	9,200	1,070.00	9,844,000
P C Iホールディングス	1,600	3,160.00	5,056,000
オープンドア	1,200	6,370.00	7,644,000
アカツキ	1,500	7,700.00	11,550,000
L I N E	20,500	4,790.00	98,195,000
オークネット	3,700	1,337.00	4,946,900
A O I T Y O Holdings	6,800	1,291.00	8,778,800

マクロミル	9,600	2,913.00	27,964,800
フェイス	5,000	1,284.00	6,420,000
野村総合研究所	48,600	5,080.00	246,888,000
サイバネットシステム	7,900	713.00	5,632,700
インタージホールディングス	9,600	1,391.00	13,353,600
フォーカスシステムズ	5,600	902.00	5,051,200
クレスコ	1,800	4,830.00	8,694,000
フジ・メディア・ホールディングス	76,700	1,674.00	128,395,800
オービック	23,000	7,790.00	179,170,000
ジャストシステム	12,000	2,116.00	25,392,000
TDCソフト	4,800	1,118.00	5,366,400
ヤフー	524,000	513.00	268,812,000
トレンドマイクロ	35,600	6,350.00	226,060,000
日本オラクル	11,800	9,980.00	117,764,000
アルファシステムズ	3,400	2,403.00	8,170,200
フューチャー	11,300	1,237.00	13,978,100
CAC Holdings	7,900	1,051.00	8,302,900
ソフトバンク・テクノロジー	3,600	1,905.00	6,858,000
トーセ	2,200	2,206.00	4,853,200
オービックビジネスコンサルタント	3,800	5,680.00	21,584,000
伊藤忠テクノソリューションズ	16,700	4,725.00	78,907,500
アイティフォー	14,400	771.00	11,102,400
大塚商会	21,800	8,400.00	183,120,000
サイボウズ	14,500	502.00	7,279,000
電通国際情報サービス	4,900	2,414.00	11,828,600
デジタルガレージ	13,400	2,891.00	38,739,400
EMシステムズ	3,600	2,499.00	8,996,400
ウェザーニューズ	3,300	3,440.00	11,352,000
WOWOW	3,700	3,230.00	11,951,000
スカラ	7,000	733.00	5,131,000
イマジカ・ロボットホールディングス	7,100	884.00	6,276,400
ネットワンシステムズ	29,900	1,610.00	48,139,000
アルゴグラフィックス	3,800	3,535.00	13,433,000
マーベラス	13,300	1,032.00	13,725,600
エイベックス	14,000	1,549.00	21,686,000
日本ユニシス	20,100	2,203.00	44,280,300
兼松エレクトロニクス	4,700	3,295.00	15,486,500
東京放送ホールディングス	44,200	2,753.00	121,682,600
日本テレビホールディングス	67,100	2,031.00	136,280,100
朝日放送	10,200	873.00	8,904,600
テレビ朝日ホールディングス	20,000	2,388.00	47,760,000
スカパーJ S A Tホールディングス	53,200	500.00	26,600,000

テレビ東京ホールディングス	6,200	2,446.00	15,165,200
ビジョン	2,200	2,693.00	5,924,600
ワイヤレスゲート	4,400	1,289.00	5,671,600
コネクシオ	5,500	2,185.00	12,017,500
日本電信電話	523,000	5,879.00	3,074,717,000
K D D I	656,100	3,215.00	2,109,361,500
光通信	8,800	16,180.00	142,384,000
N T T ドコモ	539,400	2,907.50	1,568,305,500
エムティーアイ	11,600	652.00	7,563,200
G M O インターネット	26,700	1,879.00	50,169,300
カドカワ	21,300	1,287.00	27,413,100
学研ホールディングス	3,300	4,350.00	14,355,000
ゼンリン	9,000	3,795.00	34,155,000
アイネット	5,600	1,735.00	9,716,000
松竹	4,900	18,420.00	90,258,000
東宝	48,000	3,795.00	182,160,000
東映	2,800	11,660.00	32,648,000
エヌ・ティ・ティ・データ	225,500	1,321.00	297,885,500
D T S	7,600	3,715.00	28,234,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	33,900	5,110.00	173,229,000
シーイーシー	4,800	2,549.00	12,235,200
カブコン	16,000	3,200.00	51,200,000
ジャステック	5,800	1,260.00	7,308,000
S C S K	17,500	4,915.00	86,012,500
日本システムウエア	2,800	2,545.00	7,126,000
アイネス	11,500	1,086.00	12,489,000
T K C	6,900	3,855.00	26,599,500
富士ソフト	10,100	3,465.00	34,996,500
N S D	11,600	2,309.00	26,784,400
コナミホールディングス	29,900	5,930.00	177,307,000
福井コンピュータホールディングス	2,500	3,345.00	8,362,500
J B C C ホールディングス	8,500	1,031.00	8,763,500
ミロク情報サービス	6,600	2,936.00	19,377,600
ソフトバンクグループ	329,900	9,485.00	3,129,101,500
伊藤忠食品	2,000	6,140.00	12,280,000
エレマテック	3,600	2,635.00	9,486,000
J A L U X	2,700	2,839.00	7,665,300
あらた	3,700	5,900.00	21,830,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	2,053.00	7,801,400
フィールズ	6,700	1,269.00	8,502,300
双日	433,300	324.00	140,389,200
アルフレッサ ホールディングス	81,400	2,412.00	196,336,800

横浜冷凍	18,000	1,119.00	20,142,000
アルコニックス	8,000	2,150.00	17,200,000
神戸物産	4,800	5,100.00	24,480,000
ペッパーフードサービス	3,900	7,040.00	27,456,000
あい ホールディングス	10,800	2,673.00	28,868,400
ダイワボウホールディングス	6,300	4,390.00	27,657,000
マクニカ・富士エレホールディングス	13,400	2,406.00	32,240,400
ラクト・ジャパン	1,200	4,110.00	4,932,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,500	944.00	14,632,000
U K Cホールディングス	5,500	1,930.00	10,615,000
ジュテックホールディングス	2,100	1,507.00	3,164,700
T O K A Iホールディングス	38,700	873.00	33,785,100
三洋貿易	4,400	2,468.00	10,859,200
ウイン・パートナーズ	5,500	1,261.00	6,935,500
シップヘルスケアホールディングス	15,300	3,595.00	55,003,500
コメダホールディングス	13,900	1,945.00	27,035,500
小野建	7,200	2,035.00	14,652,000
佐島電機	8,100	992.00	8,035,200
伯東	5,300	1,916.00	10,154,800
コンドーテック	8,000	1,096.00	8,768,000
ナガイレーベン	9,800	2,687.00	26,332,600
三菱食品	7,600	3,420.00	25,992,000
松田産業	6,300	1,870.00	11,781,000
第一興商	11,000	5,380.00	59,180,000
メディバルホールディングス	73,400	2,179.00	159,938,600
萩原電気	2,900	3,425.00	9,932,500
アズワン	5,800	6,440.00	37,352,000
尾家産業	4,400	1,273.00	5,601,200
シモジマ	6,000	1,168.00	7,008,000
ドウシシャ	8,200	2,305.00	18,901,000
高速	6,400	1,249.00	7,993,600
黒田電気	9,100	2,713.00	24,688,300
丸文	8,500	1,036.00	8,806,000
ハピネット	5,400	1,988.00	10,735,200
日本ライフライン	10,500	4,980.00	52,290,000
エクセル	3,300	2,488.00	8,210,400
マルカキカイ	3,700	2,159.00	7,988,300
I D O M	22,700	836.00	18,977,200
日本エム・ディ・エム	6,500	924.00	6,006,000
進和	5,200	2,564.00	13,332,800
ダイトロン	4,100	2,297.00	9,417,700
シークス	4,700	4,750.00	22,325,000

オーハシテクニカ	5,600	1,641.00	9,189,600
伊藤忠商事	536,800	1,946.00	1,044,612,800
丸紅	602,000	745.80	448,971,600
長瀬産業	44,600	2,053.00	91,563,800
蝶理	5,500	2,081.00	11,445,500
豊田通商	81,600	4,220.00	344,352,000
三共生興	18,800	485.00	9,118,000
兼松	30,800	1,346.00	41,456,800
三井物産	621,800	1,705.00	1,060,169,000
日本紙パルプ商事	4,000	4,295.00	17,180,000
日立ハイテクノロジーズ	25,400	4,645.00	117,983,000
カメイ	10,000	1,810.00	18,100,000
スターゼン	3,100	5,410.00	16,771,000
山善	28,100	1,277.00	35,883,700
住友商事	461,800	1,743.50	805,148,300
内田洋行	3,700	3,210.00	11,877,000
三菱商事	513,300	2,813.00	1,443,912,900
第一実業	3,900	3,395.00	13,240,500
キャノンマーケティングジャパン	21,100	2,870.00	60,557,000
西華産業	5,000	2,724.00	13,620,000
佐藤商事	8,700	1,237.00	10,761,900
菱洋エレクトロ	7,300	1,920.00	14,016,000
東京産業	12,500	529.00	6,612,500
ユアサ商事	7,000	3,940.00	27,580,000
神鋼商事	1,900	3,040.00	5,776,000
阪和興業	14,000	4,525.00	63,350,000
正栄食品工業	4,200	4,750.00	19,950,000
カナデン	9,100	1,387.00	12,621,700
菱電商事	6,700	1,737.00	11,637,900
フルサト工業	5,800	1,859.00	10,782,200
岩谷産業	16,500	3,390.00	55,935,000
すてきナイスグループ	4,900	1,543.00	7,560,700
イワキ	14,000	489.00	6,846,000
三愛石油	19,500	1,608.00	31,356,000
稲畑産業	17,400	1,739.00	30,258,600
ワキタ	16,000	1,328.00	21,248,000
東邦ホールディングス	22,100	2,333.00	51,559,300
サンゲツ	25,200	2,049.00	51,634,800
ミツウロコグループホールディングス	12,600	822.00	10,357,200
シナネンホールディングス	4,200	2,510.00	10,542,000
伊藤忠エネクス	16,100	1,125.00	18,112,500
サンリオ	21,000	1,865.00	39,165,000

サンワテクノス	5,000	2,035.00	10,175,000
リョーサン	9,400	4,345.00	40,843,000
新光商事	8,500	1,972.00	16,762,000
トーホー	4,100	2,742.00	11,242,200
三信電気	7,400	1,695.00	12,543,000
東陽テクニカ	10,700	958.00	10,250,600
モスフードサービス	9,600	3,445.00	33,072,000
加賀電子	6,700	3,145.00	21,071,500
ソーダニッカ	12,800	576.00	7,372,800
立花エレテック	5,700	1,887.00	10,755,900
PALTA C	10,000	4,980.00	49,800,000
三谷産業	13,600	424.00	5,766,400
太平洋興発	5,600	1,006.00	5,633,600
西本Wismettacホールディングス	1,600	4,075.00	6,520,000
ヤマタネ	5,200	2,186.00	11,367,200
日鉄住金物産	5,500	5,920.00	32,560,000
トラスコ中山	15,100	3,140.00	47,414,000
オートバックスセブン	29,100	2,152.00	62,623,200
モリト	7,900	1,050.00	8,295,000
加藤産業	11,200	4,045.00	45,304,000
イノテック	8,000	1,010.00	8,080,000
イエローハット	7,100	3,275.00	23,252,500
J Kホールディングス	10,300	1,006.00	10,361,800
日伝	6,200	2,324.00	14,408,800
杉本商事	6,000	1,733.00	10,398,000
因幡電機産業	9,500	5,260.00	49,970,000
バイテックホールディングス	4,000	1,713.00	6,852,000
ミスミグループ本社	84,900	3,275.00	278,047,500
タキヒヨー	3,200	2,368.00	7,577,600
スズケン	33,400	4,440.00	148,296,000
ジェコス	6,500	1,406.00	9,139,000
ローソン	18,500	7,740.00	143,190,000
サンエー	5,400	5,190.00	28,026,000
カワチ薬品	5,800	2,800.00	16,240,000
エービーシー・マート	13,400	6,160.00	82,544,000
ハードオフコーポレーション	5,800	1,269.00	7,360,200
アスクル	7,700	3,130.00	24,101,000
ゲオホールディングス	13,300	2,277.00	30,284,100
アダストリア	11,300	2,485.00	28,080,500
くらコーポレーション	4,400	5,240.00	23,056,000
キャンドゥ	5,100	1,745.00	8,899,500
パルグループホールディングス	4,000	3,465.00	13,860,000

エディオン	27,800	1,261.00	35,055,800
サーラコーポレーション	14,300	691.00	9,881,300
ハローズ	3,200	2,598.00	8,313,600
あみやき亭	1,900	5,060.00	9,614,000
ひらまつ	14,200	560.00	7,952,000
ゲンキー	3,400	4,185.00	14,229,000
大黒天物産	2,000	5,260.00	10,520,000
ハニーズホールディングス	8,800	1,150.00	10,120,000
アルペン	6,100	2,297.00	14,011,700
クオール	7,500	2,149.00	16,117,500
ジーンズ	5,100	5,760.00	29,376,000
ビックカメラ	41,800	1,432.00	59,857,600
D C Mホールディングス	39,700	1,085.00	43,074,500
Monotaro	26,300	3,190.00	83,897,000
DDホールディングス	1,700	4,985.00	8,474,500
アークランドサービスホールディングス	6,400	2,767.00	17,708,800
J.フロント リテイリング	87,100	1,895.00	165,054,500
ドトール・日レスホールディングス	12,800	2,684.00	34,355,200
マツモトキヨシホールディングス	15,100	9,280.00	140,128,000
ブロンコビリー	4,300	3,175.00	13,652,500
スタートトゥデイ	71,900	3,425.00	246,257,500
物語コーポレーション	2,200	9,790.00	21,538,000
ココカラファイン	7,600	7,000.00	53,200,000
三越伊勢丹ホールディングス	136,500	1,299.00	177,313,500
Hamee	2,700	1,705.00	4,603,500
ウエルシアホールディングス	19,300	4,810.00	92,833,000
クリエイトSDホールディングス	10,700	2,928.00	31,329,600
チムニー	2,700	2,821.00	7,616,700
シュッピン	2,400	3,215.00	7,716,000
ネクステージ	7,800	907.00	7,074,600
ジョイフル本田	11,900	3,205.00	38,139,500
鳥貴族	3,100	3,135.00	9,718,500
ホットランド	5,300	1,491.00	7,902,300
すかいらーく	45,200	1,643.00	74,263,600
綿半ホールディングス	3,400	2,590.00	8,806,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	21,800	1,149.00	25,048,200
あさひ	6,500	1,378.00	8,957,000
日本調剤	2,900	3,665.00	10,628,500
コスモス薬品	3,700	25,270.00	93,499,000
セブン&アイ・ホールディングス	306,500	4,605.00	1,411,432,500
薬王堂	3,300	3,420.00	11,286,000
クリエイト・レストランツ・ホールディング	19,500	1,228.00	23,946,000

ツルハホールディングス	14,700	15,520.00	228,144,000
サンマルクホールディングス	4,900	3,085.00	15,116,500
トリドールホールディングス	9,100	3,620.00	32,942,000
TOKYO BASE	1,500	4,600.00	6,900,000
パロックジャパンリミテッド	7,200	954.00	6,868,800
クスリのアオキホールディングス	5,700	6,840.00	38,988,000
スシログローバルホールディングス	6,900	3,880.00	26,772,000
LIXILビバ	7,500	1,780.00	13,350,000
メディカルシステムネットワーク	12,200	595.00	7,259,000
総合メディカル	3,200	6,050.00	19,360,000
ノジマ	12,800	2,576.00	32,972,800
カッパ・クリエイト	11,200	1,294.00	14,492,800
ライトオン	8,000	910.00	7,280,000
良品計画	9,700	35,050.00	339,985,000
アドヴァン	9,000	1,037.00	9,333,000
アルビス	2,000	4,300.00	8,600,000
コナカ	14,000	609.00	8,526,000
G-7ホールディングス	2,800	2,426.00	6,792,800
コジマ	16,600	365.00	6,059,000
コーナン商事	10,600	2,340.00	24,804,000
エコス	4,800	1,208.00	5,798,400
ワタミ	10,000	1,575.00	15,750,000
ドンキホーテホールディングス	47,400	5,370.00	254,538,000
西松屋チェーン	15,900	1,358.00	21,592,200
ゼンショーホールディングス	38,500	1,900.00	73,150,000
幸楽苑ホールディングス	5,500	1,771.00	9,740,500
サイゼリヤ	10,800	3,510.00	37,908,000
VTホールディングス	26,000	552.00	14,352,000
ユナイテッドアローズ	9,200	4,240.00	39,008,000
ハイデイ日高	8,100	3,385.00	27,418,500
京都きもの友禅	7,200	787.00	5,666,400
コロワイド	24,000	2,157.00	51,768,000
ピーシーデポコーポレーション	11,900	926.00	11,019,400
壱番屋	5,100	4,405.00	22,465,500
スギホールディングス	16,200	6,020.00	97,524,000
ヴィア・ホールディングス	9,300	753.00	7,002,900
スクロール	15,700	485.00	7,614,500
ヨンドシーホールディングス	7,700	3,045.00	23,446,500
ユニー・ファミリーマートホールディングス	23,400	7,570.00	177,138,000
木曽路	9,300	2,721.00	25,305,300
SRSホールディングス	11,800	922.00	10,879,600
千趣会	15,300	676.00	10,342,800

ケーヨー	15,700	713.00	11,194,100
上新電機	8,700	4,385.00	38,149,500
日本瓦斯	13,500	3,970.00	53,595,000
ロイヤルホールディングス	12,900	3,085.00	39,796,500
いなげや	8,400	1,842.00	15,472,800
島忠	19,400	3,230.00	62,662,000
チヨダ	8,500	2,925.00	24,862,500
ライフコーポレーション	5,400	3,005.00	16,227,000
リンガーハット	9,000	2,580.00	23,220,000
MrMaxHD	11,400	850.00	9,690,000
AOKIホールディングス	14,700	1,640.00	24,108,000
オークワ	12,000	1,134.00	13,608,000
コメリ	12,000	3,200.00	38,400,000
青山商事	14,400	4,280.00	61,632,000
しまむら	8,500	13,530.00	115,005,000
高島屋	115,000	1,107.00	127,305,000
松屋	15,000	1,331.00	19,965,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	35,000	2,188.00	76,580,000
近鉄百貨店	3,000	3,715.00	11,145,000
パルコ	7,200	1,539.00	11,080,800
丸井グループ	70,300	1,986.00	139,615,800
アクシアル リテイリング	5,900	4,230.00	24,957,000
イオン	281,900	1,824.00	514,185,600
イズミ	13,300	6,590.00	87,647,000
平和堂	14,600	2,422.00	35,361,200
フジ	8,400	2,466.00	20,714,400
ヤオコー	8,200	5,290.00	43,378,000
ゼビオホールディングス	9,900	2,067.00	20,463,300
ケーズホールディングス	31,300	2,896.00	90,644,800
Olympicグループ	9,100	591.00	5,378,100
日産東京販売ホールディングス	15,700	409.00	6,421,300
アインホールディングス	10,600	7,650.00	81,090,000
元気寿司	2,400	4,470.00	10,728,000
ヤマダ電機	244,800	610.00	149,328,000
アーランドサカモト	12,800	1,871.00	23,948,800
ニトリホールディングス	29,000	18,335.00	531,715,000
グルメ杵屋	7,000	1,144.00	8,008,000
吉野家ホールディングス	25,600	1,863.00	47,692,800
松屋フーズ	3,700	4,115.00	15,225,500
サガミチェーン	11,200	1,394.00	15,612,800
関西スーパーマーケット	6,900	1,262.00	8,707,800
王将フードサービス	5,300	4,980.00	26,394,000

プレナス	8,200	2,346.00	19,237,200
ミニストップ	5,700	2,334.00	13,303,800
アークス	13,500	2,594.00	35,019,000
パローホールディングス	17,500	2,617.00	45,797,500
ベルク	3,300	6,290.00	20,757,000
大庄	5,600	1,676.00	9,385,600
ファーストリテイリング	12,200	43,510.00	530,822,000
サンドラッグ	31,000	5,170.00	160,270,000
サックスパー ホールディングス	7,900	1,398.00	11,044,200
ペルーナ	18,000	1,227.00	22,086,000
じもとホールディングス	53,000	189.00	10,017,000
めぶきフィナンシャルグループ	378,000	471.00	178,038,000
東京ＴＹフィナンシャルグループ	10,100	3,000.00	30,300,000
九州フィナンシャルグループ	121,200	664.00	80,476,800
ゆうちょ銀行	205,400	1,427.00	293,105,800
富山第一銀行	20,000	508.00	10,160,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	445,600	615.00	274,044,000
西日本フィナンシャルホールディングス	50,000	1,257.00	62,850,000
新生銀行	63,300	1,793.00	113,496,900
あおぞら銀行	43,600	4,355.00	189,878,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,174,500	792.10	4,098,721,450
りそなホールディングス	803,000	595.90	478,507,700
三井住友トラスト・ホールディングス	143,900	4,164.00	599,199,600
三井住友フィナンシャルグループ	554,300	4,547.00	2,520,402,100
第四銀行	9,100	4,905.00	44,635,500
北越銀行	7,600	2,496.00	18,969,600
千葉銀行	261,000	859.00	224,199,000
群馬銀行	150,000	666.00	99,900,000
武蔵野銀行	12,000	3,570.00	42,840,000
千葉興業銀行	21,000	597.00	12,537,000
筑波銀行	31,800	386.00	12,274,800
七十七銀行	23,200	2,648.00	61,433,600
青森銀行	5,800	3,585.00	20,793,000
秋田銀行	4,900	3,045.00	14,920,500
山形銀行	8,500	2,471.00	21,003,500
岩手銀行	5,000	4,485.00	22,425,000
東邦銀行	67,000	398.00	26,666,000
東北銀行	4,000	1,507.00	6,028,000
みちのく銀行	5,000	1,820.00	9,100,000
ふくおかフィナンシャルグループ	298,000	582.00	173,436,000
静岡銀行	191,000	1,108.00	211,628,000
十六銀行	10,000	3,330.00	33,300,000

スルガ銀行	74,900	2,411.00	180,583,900
八十二銀行	130,800	640.00	83,712,000
山梨中央銀行	46,000	478.00	21,988,000
大垣共立銀行	11,700	2,881.00	33,707,700
福井銀行	6,400	2,733.00	17,491,200
北國銀行	8,200	4,355.00	35,711,000
清水銀行	2,600	3,225.00	8,385,000
富山銀行	1,500	4,255.00	6,382,500
滋賀銀行	70,000	580.00	40,600,000
南都銀行	8,800	3,035.00	26,708,000
百五銀行	69,000	518.00	35,742,000
京都銀行	27,900	5,720.00	159,588,000
紀陽銀行	28,000	1,877.00	52,556,000
三重銀行	3,500	2,534.00	8,869,000
ほくほくフィナンシャルグループ	49,000	1,675.00	82,075,000
広島銀行	108,500	883.00	95,805,500
山陰合同銀行	44,000	1,014.00	44,616,000
中国銀行	51,000	1,463.00	74,613,000
伊予銀行	105,000	877.00	92,085,000
百十四銀行	79,000	370.00	29,230,000
四国銀行	11,500	1,583.00	18,204,500
阿波銀行	59,000	691.00	40,769,000
大分銀行	4,300	4,450.00	19,135,000
宮崎銀行	5,000	3,585.00	17,925,000
佐賀銀行	4,700	2,550.00	11,985,000
十八銀行	46,000	293.00	13,478,000
沖縄銀行	7,200	4,395.00	31,644,000
琉球銀行	14,500	1,622.00	23,519,000
セブン銀行	276,400	376.00	103,926,400
みずほフィナンシャルグループ	9,950,000	203.90	2,028,805,000
山口フィナンシャルグループ	69,000	1,341.00	92,529,000
名古屋銀行	6,000	4,300.00	25,800,000
北洋銀行	112,000	360.00	40,320,000
愛知銀行	2,500	6,310.00	15,775,000
第三銀行	4,500	1,825.00	8,212,500
中京銀行	3,300	2,330.00	7,689,000
大光銀行	2,800	2,494.00	6,983,200
愛媛銀行	10,500	1,415.00	14,857,500
みなと銀行	7,000	2,071.00	14,497,000
京葉銀行	63,000	511.00	32,193,000
関西アーバン銀行	10,500	1,411.00	14,815,500
栃木銀行	39,000	480.00	18,720,000

北日本銀行	2,400	3,005.00	7,212,000
東和銀行	13,300	1,311.00	17,436,300
福島銀行	7,500	910.00	6,825,000
大東銀行	3,800	1,670.00	6,346,000
トモニホールディングス	62,000	544.00	33,728,000
フィデアホールディングス	73,000	204.00	14,892,000
池田泉州ホールディングス	79,000	404.00	31,916,000
F P G	26,600	1,383.00	36,787,800
S B Iホールディングス	83,000	1,995.00	165,585,000
ジャフコ	10,600	5,890.00	62,434,000
大和証券グループ本社	627,000	698.00	437,646,000
野村ホールディングス	1,322,000	670.50	886,401,000
岡三証券グループ	63,000	686.00	43,218,000
丸三証券	24,000	1,051.00	25,224,000
東洋証券	27,000	324.00	8,748,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	85,000	726.00	61,710,000
水戸証券	24,000	429.00	10,296,000
いちよし証券	16,000	1,280.00	20,480,000
松井証券	36,500	983.00	35,879,500
マネックスグループ	80,000	327.00	26,160,000
カブドットコム証券	49,000	342.00	16,758,000
極東証券	10,200	1,645.00	16,779,000
岩井コスモホールディングス	7,600	1,441.00	10,951,600
藍澤証券	14,800	752.00	11,129,600
マネーパートナーズグループ	11,000	432.00	4,752,000
かんぽ生命保険	27,800	2,446.00	67,998,800
S O M P Oホールディングス	143,600	4,532.00	650,795,200
アニコム ホールディングス	5,100	3,230.00	16,473,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	191,400	3,655.00	699,567,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	60,300	1,898.00	114,449,400
第一生命ホールディングス	414,200	2,296.00	951,003,200
東京海上ホールディングス	276,000	4,960.00	1,368,960,000
T & Dホールディングス	226,200	1,845.50	417,452,100
アドバンスクリエイト	2,000	1,961.00	3,922,000
全国保証	20,900	4,835.00	101,051,500
クレディセゾン	55,600	2,159.00	120,040,400
芙蓉総合リース	8,600	7,450.00	64,070,000
興銀リース	14,000	2,867.00	40,138,000
東京センチュリー	14,700	5,090.00	74,823,000
日本証券金融	33,000	610.00	20,130,000
アイフル	127,000	384.00	48,768,000
リコーリース	6,200	3,855.00	23,901,000

イオンフィナンシャルサービス	51,900	2,491.00	129,282,900
アコム	148,400	467.00	69,302,800
ジャックス	9,100	2,589.00	23,559,900
オリエントコーポレーション	162,700	184.00	29,936,800
日立キャピタル	20,500	2,766.00	56,703,000
オリックス	488,400	1,934.00	944,565,600
三菱UFJリース	185,500	639.00	118,534,500
日本取引所グループ	214,700	2,062.00	442,711,400
イー・ギャランティ	2,500	3,300.00	8,250,000
NECキャピタルソリューション	3,800	2,317.00	8,804,600
いちご	103,000	416.00	42,848,000
日本駐車場開発	96,800	165.00	15,972,000
ヒューリック	152,900	1,231.00	188,219,900
三栄建築設計	3,300	2,406.00	7,939,800
野村不動産ホールディングス	48,900	2,588.00	126,553,200
三重交通グループホールディングス	17,500	476.00	8,330,000
サムティ	6,800	1,658.00	11,274,400
日本商業開発	4,700	1,657.00	7,787,900
プレサンスコーポレーション	10,700	1,394.00	14,915,800
ユニゾホールディングス	8,700	3,015.00	26,230,500
日本管理センター	5,800	1,519.00	8,810,200
フージャースホールディングス	10,900	1,178.00	12,840,200
オープンハウス	11,800	5,540.00	65,372,000
東急不動産ホールディングス	175,800	810.00	142,398,000
飯田グループホールディングス	60,800	2,070.00	125,856,000
ムゲンエステート	5,600	1,160.00	6,496,000
ケイアイスター不動産	3,000	2,683.00	8,049,000
パーク24	41,000	2,768.00	113,488,000
パラカ	3,400	2,377.00	8,081,800
三井不動産	365,500	2,536.00	926,908,000
三菱地所	545,100	2,002.50	1,091,562,750
平和不動産	13,400	2,098.00	28,113,200
東京建物	80,100	1,556.00	124,635,600
ダイビル	19,300	1,259.00	24,298,700
京阪神ビルディング	17,100	833.00	14,244,300
住友不動産	176,000	3,696.00	650,496,000
大京	11,200	2,187.00	24,494,400
テーオーシー	26,300	940.00	24,722,000
東京楽天地	1,900	6,000.00	11,400,000
レオパレス21	92,100	900.00	82,890,000
スターツコーポレーション	9,700	2,741.00	26,587,700
フジ住宅	13,400	840.00	11,256,000

空港施設	13,400	653.00	8,750,200
ゴールドクレスト	6,100	2,309.00	14,084,900
日本エスリード	3,700	2,340.00	8,658,000
日神不動産	11,100	836.00	9,279,600
日本エスコン	14,100	627.00	8,840,700
タカラレーベン	34,400	509.00	17,509,600
サンヨーハウジング名古屋	6,500	1,197.00	7,780,500
イオンモール	47,500	2,054.00	97,565,000
トーセイ	10,100	1,095.00	11,059,500
エヌ・ティ・ティ都市開発	46,200	1,235.00	57,057,000
サンフロンティア不動産	8,300	1,502.00	12,466,600
エフ・ジェー・ネクスト	7,200	994.00	7,156,800
日本空港ビルデング	21,500	4,190.00	90,085,000
日本工営	5,000	3,745.00	18,725,000
L I F U L L	25,200	919.00	23,158,800
ジェイエイシーリクルートメント	6,100	2,269.00	13,840,900
日本M&Aセンター	24,700	5,610.00	138,567,000
タケエイ	8,700	1,307.00	11,370,900
トラスト・テック	3,300	3,870.00	12,771,000
コシダカホールディングス	3,900	4,925.00	19,207,500
パソナグループ	6,200	1,728.00	10,713,600
リンクアンドモチベーション	13,900	888.00	12,343,200
G C A	9,500	1,118.00	10,621,000
エス・エム・エス	14,100	3,590.00	50,619,000
パーソルホールディングス	65,300	2,628.00	171,608,400
リニカル	5,400	1,545.00	8,343,000
クックパッド	23,800	670.00	15,946,000
学情	4,300	1,486.00	6,389,800
スタジオアリス	4,300	2,622.00	11,274,600
シミックホールディングス	5,300	1,690.00	8,957,000
総合警備保障	28,200	6,230.00	175,686,000
カカクコム	55,300	1,774.00	98,102,200
アイロムグループ	3,000	1,773.00	5,319,000
ルネサンス	4,600	1,812.00	8,335,200
ディップ	10,000	2,916.00	29,160,000
オプトホールディング	6,100	1,323.00	8,070,300
ツクイ	18,300	919.00	16,817,700
エムスリー	74,800	3,690.00	276,012,000
アウトソーシング	21,000	1,972.00	41,412,000
ウェルネット	7,000	1,210.00	8,470,000
ワールドホールディングス	2,400	2,904.00	6,969,600
ディー・エヌ・エー	38,600	2,545.00	98,237,000

博報堂D Yホールディングス	97,900	1,509.00	147,731,100
ぐるなび	11,800	1,368.00	16,142,400
エスアールジータカミヤ	10,700	667.00	7,136,900
ジャパンベストレスキューシステム	11,500	583.00	6,704,500
ファンコミュニケーションズ	20,100	973.00	19,557,300
ライク	3,200	2,343.00	7,497,600
WDBホールディングス	3,600	3,175.00	11,430,000
バリューコマース	7,500	770.00	5,775,000
インフォマート	36,900	682.00	25,165,800
J Pホールディングス	26,000	352.00	9,152,000
E P Sホールディングス	11,100	2,415.00	26,806,500
プレステージ・インターナショナル	15,500	1,412.00	21,886,000
アミューズ	5,000	3,145.00	15,725,000
ドリームインキュベータ	3,100	2,438.00	7,557,800
クイック	4,900	1,801.00	8,824,900
ケネディクス	98,500	766.00	75,451,000
電通	86,300	5,080.00	438,404,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,000	1,314.00	7,884,000
ぴあ	2,500	6,700.00	16,750,000
イオンファンタジー	2,500	4,890.00	12,225,000
シーティーエス	8,500	950.00	8,075,000
ネクシィーズグループ	3,200	1,845.00	5,904,000
みらかホールディングス	21,400	4,875.00	104,325,000
アルプス技研	3,400	3,775.00	12,835,000
日本空調サービス	10,100	799.00	8,069,900
オリエンタルランド	83,900	9,991.00	838,244,900
ダスキン	19,800	2,928.00	57,974,400
明光ネットワークジャパン	10,100	1,351.00	13,645,100
ファルコホールディングス	5,500	1,725.00	9,487,500
ラウンドワン	22,400	1,728.00	38,707,200
リゾートトラスト	30,700	2,456.00	75,399,200
ビー・エム・エル	9,200	2,706.00	24,895,200
りらいあコミュニケーションズ	11,400	1,268.00	14,455,200
リソー教育	13,600	859.00	11,682,400
ユー・エス・エス	87,000	2,365.00	205,755,000
サイバーエージェント	46,800	3,830.00	179,244,000
楽天	364,500	1,147.50	418,263,750
クリーク・アンド・リバー社	4,400	1,161.00	5,108,400
テー・オー・ダブリュー	8,700	968.00	8,421,600
セントラルスポーツ	3,100	4,130.00	12,803,000
フルキャストホールディングス	6,300	2,174.00	13,696,200
テクノプロ・ホールディングス	12,900	5,630.00	72,627,000

イー・ガーディアン	4,100	2,310.00	9,471,000
ジャパンマテリアル	6,600	3,330.00	21,978,000
ベクトル	9,000	1,566.00	14,094,000
I B J	6,600	1,036.00	6,837,600
アサンテ	4,100	1,948.00	7,986,800
N・フィールド	4,600	1,480.00	6,808,000
バリューHR	1,100	5,250.00	5,775,000
M&Aキャピタルパートナーズ	1,500	7,040.00	10,560,000
アビスト	1,300	5,230.00	6,799,000
ウィルグループ	3,700	1,723.00	6,375,100
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,000	602.00	6,622,000
リクルートホールディングス	547,500	2,647.00	1,449,232,500
日本郵政	401,800	1,292.00	519,125,600
ベルシステム24ホールディングス	12,400	1,392.00	17,260,800
エボラブルアジア	2,000	2,283.00	4,566,000
ストライク	800	4,900.00	3,920,000
ソラスト	4,800	2,687.00	12,897,600
リログループ	38,900	2,988.00	116,233,200
東祥	4,800	3,460.00	16,608,000
エイチ・アイ・エス	11,000	4,225.00	46,475,000
共立メンテナンス	12,600	4,040.00	50,904,000
イチネンホールディングス	9,500	1,598.00	15,181,000
建設技術研究所	7,000	1,134.00	7,938,000
スペース	5,200	1,747.00	9,084,400
東京テアトル	4,400	1,500.00	6,600,000
ナガワ	1,600	4,770.00	7,632,000
よみうりランド	2,100	4,945.00	10,384,500
東京都競馬	5,500	3,880.00	21,340,000
常磐興産	4,800	1,856.00	8,908,800
カナモト	10,900	3,875.00	42,237,500
東京ドーム	29,500	1,110.00	32,745,000
西尾レントオール	6,300	3,835.00	24,160,500
トランス・コスモス	7,900	2,741.00	21,653,900
乃村工藝社	16,500	2,566.00	42,339,000
藤田観光	3,400	3,675.00	12,495,000
KNT-CTホールディングス	4,900	1,708.00	8,369,200
日本管財	8,000	2,035.00	16,280,000
トーカイ	3,600	4,685.00	16,866,000
セコム	75,300	8,414.00	633,574,200
セントラル警備保障	4,400	2,041.00	8,980,400
丹青社	14,500	1,430.00	20,735,000
メイテック	8,500	5,900.00	50,150,000

アサツー ディ・ケイ	13,500	3,660.00	49,410,000	
応用地質	9,000	1,520.00	13,680,000	
船井総研ホールディングス	9,900	3,735.00	36,976,500	
オオバ	10,400	511.00	5,314,400	
ベネッセホールディングス	26,100	3,960.00	103,356,000	
イオンディライト	8,500	4,250.00	36,125,000	
ナック	7,200	932.00	6,710,400	
ニチイ学館	14,000	1,380.00	19,320,000	
ダイセキ	12,700	2,965.00	37,655,500	
合 計	89,136,800		190,034,814,150	

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

【中間財務諸表】

- 1 . 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 . 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第7期中間計算期間(平成29年12月1日から平成30年 5月31日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

第7期中間計算期間
(平成30年 5月31日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	22,693,450
コール・ローン	684,442
親投資信託受益証券	14,330,840,206
流動資産合計	14,354,218,098
資産合計	14,354,218,098
負債の部	
流動負債	
未払解約金	23,357,641
未払受託者報酬	8,419
未払委託者報酬	58,931
未払利息	2
その他未払費用	3,616
流動負債合計	23,428,609
負債合計	23,428,609
純資産の部	
元本等	
元本	5,441,360,687
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	8,889,428,802
元本等合計	14,330,789,489
純資産合計	14,330,789,489
負債純資産合計	14,354,218,098

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

第7期中間計算期間	
自 平成29年12月 1日	
至 平成30年 5月31日	
営業収益	
有価証券売買等損益	191,778,088
営業収益合計	191,778,088
営業費用	
支払利息	11,006
受託者報酬	1,273,425
委託者報酬	8,913,895
その他費用	323,889
営業費用合計	10,522,215
営業利益又は営業損失（ ）	202,300,303
経常利益又は経常損失（ ）	202,300,303
中間純利益又は中間純損失（ ）	202,300,303
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	6,219,695
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	5,983,570,661
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,987,660,520
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,987,660,520
剰余金減少額又は欠損金増加額	885,721,771
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	885,721,771
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,889,428,802

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第7期中間計算期間
	自 平成29年12月 1日 至 平成30年 5月31日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第7期中間計算期間	
	(平成30年 5月31日現在)	
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数		5,441,360,687口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.6337円
	(10,000口当たりの純資産額	26,337円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第7期中間計算期間 (平成30年 5月31日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第7期中間計算期間 (平成30年 5月31日現在)
期首元本額	3,577,531,089円
期中追加設定元本額	2,392,245,095円
期中一部解約元本額	528,415,497円

（参考）

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンドは、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

貸借対照表

（単位：円）

（平成30年 5月31日現在）

資産の部	
流動資産	
金銭信託	2,880,959,971
コール・ローン	86,890,653
株式	174,668,224,185
派生商品評価勘定	383,520
未収入金	32,740,136

(平成30年 5月31日現在)

未収配当金	1,529,345,259
前払金	109,395,000
差入委託証拠金	20,160,000
流動資産合計	179,328,098,724
資産合計	179,328,098,724
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	109,999,920
未払金	311,080
未払解約金	543,440,810
未払利息	254
その他未払費用	91,522
流動負債合計	653,843,586
負債合計	653,843,586
純資産の部	
元本等	
元本	66,474,271,481
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	112,199,983,657
元本等合計	178,674,255,138
純資産合計	178,674,255,138
負債純資産合計	179,328,098,724

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成29年12月1日 至平成30年5月31日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3.収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年 5月31日現在）	
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。	
	株式	2,768,400,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		66,474,271,481口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.6879円
	(10,000口当たりの純資産額)	26,879円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成30年 5月31日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成30年 5月31日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,174,301,400	-	4,064,685,000	109,616,400
	東証株価指数先物	4,174,301,400	-	4,064,685,000	109,616,400
合計		4,174,301,400	-	4,064,685,000	109,616,400

（注）1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成30年 5月31日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	70,854,907,568円
同期中における追加設定元本額	6,716,833,775円
同期中における一部解約元本額	11,097,469,862円
平成30年 5月31日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,997,650,927円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	660,500,300円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,224,692,395円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,391,633,832円
S M A M ・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	100,847,732円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	6,694,581円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	22,118,808円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	54,689,807円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	75,240,325円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	43,404,534円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	108,828,622円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,640,008,847円
三井住友・DCつみたてN I S A ・日本株インデックスファンド	5,331,612,116円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	408,296,995円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	635,446,472円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	639,495,466円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	5,172,846円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	409,120円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,526,715円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	11,011,505円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	12,269,558円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	46,305,938円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	2,729,594円
S M A M ・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	6,702,593,267円
バランスファンドV A (安定運用型) <適格機関投資家限定>	30,552,452円
S M A M ・バランスファンドV A 安定成長型 <適格機関投資家限定>	1,621,652,913円
S M A M ・バランスファンドV A 25 <適格機関投資家専用>	3,723,083,759円
S M A M ・バランスファンドV A 37.5 <適格機関投資家専用>	2,541,930,001円
S M A M ・バランスファンドV A 50 <適格機関投資家専用>	9,267,546,795円
S M A M ・バランスファンドV L 30 <適格機関投資家限定>	55,692,858円

S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	223,864,778円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,265,342円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	1,015,708,872円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	55,900,666円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	372,404,911円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,099,122,600円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	1,082,868,303円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	3,206,699,719円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	53,690,171円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,459,258,724円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	69,976,334円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	107,350,065円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	1,676,254,768円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	108,307,233円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	46,434,041円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	21,719,013円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	216,507,265円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	393,078,335円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	162,473,705円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	115,295,212円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	58,362,562円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	10,799,533円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	76,653,431円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	979,640,000円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・V A (適格機関投資家専用)	198,079,929円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	20,110,391円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型)V A < 適格機関投資家限定 >	1,787,366,166円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型)V A < 適格機関投資家限定 >	265,581,987円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,683,022,698円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	240,219,569円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド< 適格機関投資家限定 >	11,047,302円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	116,085,545円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	55,605,849円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン< 適格機関投資家限定 >	119,869,193円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド< 適格機関投資家限定 >	8,189円
合計	66,474,271,481円

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

2018年 6月29日現在

資産総額	15,145,973,676円
負債総額	40,038,968円
純資産総額（ - ）	15,105,934,708円
発行済口数	5,783,912,997口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6117円
（1万口当たり純資産額）	（26,117円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、ファンドの受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券は発行されません。

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

- a. 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b. 上記 a の申請のある場合には、上記 a の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記 a の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- c. 上記 a の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

ホ 受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

へ 償還金

償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2018年6月29日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

八 会社の機構

委託会社の取締役は7名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

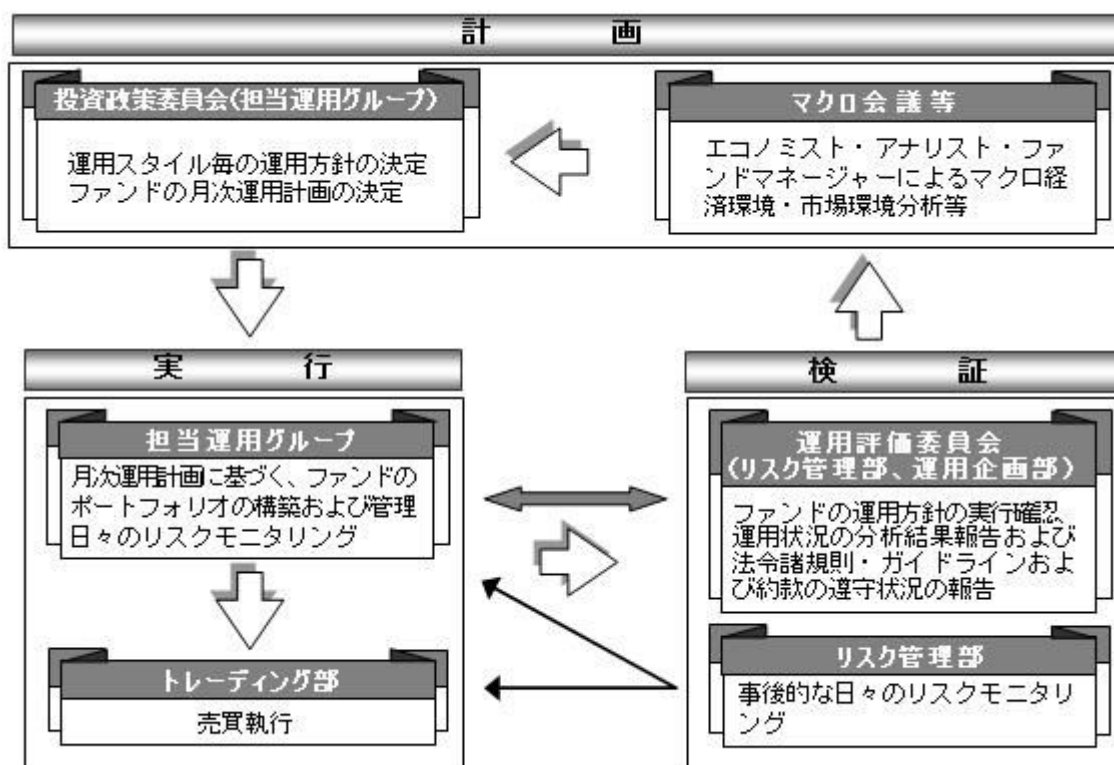
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定します。

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として投資運用業および投資助言業務を行っています。また、「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業にかかる業務を行っています。

2018年6月29日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（2018年6月29日現在）

		本数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	88 (41)	345,854 (262,846)
	追加型	466 (198)	5,809,736 (2,828,009)
	計	554 (239)	6,155,590 (3,090,855)
公社債投資信託	単位型	107 (107)	300,164 (300,164)
	追加型	1 (0)	30,353 (0)
	計	108 (107)	330,517 (300,164)
合計		662 (346)	6,486,107 (3,391,019)

（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

3【委託会社等の経理状況】

1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2 当社は、当事業年度（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,279,384	20,873,870
顧客分別金信託	20,008	20,010
前払費用	351,526	402,249
未収入金	40,544	39,030
未収委託者報酬	5,511,715	6,332,203
未収運用受託報酬	1,297,104	1,725,215
未収投資助言報酬	343,523	316,407

未収収益		20,789	50,321
繰延税金資産		482,535	715,988
その他の流動資産		5,560	10,891
流動資産合計		21,352,691	30,486,188
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		198,767	185,371
器具備品		261,096	300,694
有形固定資産合計		459,864	486,065
無形固定資産			
ソフトウェア		493,806	409,765
ソフトウェア仮勘定		141,025	5,755
電話加入権		68	56
商標権		3	-
無形固定資産合計		634,903	415,576
投資その他の資産			
投資有価証券		12,098,372	10,616,594
関係会社株式		10,412,523	10,412,523
長期差入保証金		677,681	658,505
長期前払費用		61,282	69,423
会員権		7,819	7,819
繰延税金資産		871,577	678,459
投資その他の資産合計		24,129,257	22,443,325
固定資産合計		25,224,025	23,344,968
資産合計		46,576,717	53,831,157

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	304	84
その他の預り金	80,380	92,326
未払金		
未払収益分配金	655	649
未払償還金	140,124	137,522
未払手数料	2,424,318	2,783,763
その他未払金	52,903	236,739
未払費用	2,564,625	3,433,641
未払消費税等	160,571	547,706
未払法人税等	661,467	1,785,341
賞与引当金	1,001,068	1,507,256
その他の流動負債	445	1,408
流動負債合計	7,086,864	10,526,438
固定負債		
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830
賞与引当金	40,167	99,721
その他の固定負債	2,174	3,363
固定負債合計	3,219,473	3,422,915
負債合計	10,306,337	13,949,354

純資産の部

株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	23,493,074	26,561,078
利益剰余金合計	25,314,279	28,382,283
株主資本計	35,943,263	39,011,267
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	327,116	870,535
評価・換算差額等合計	327,116	870,535
純資産合計	36,270,379	39,881,802
負債・純資産合計	46,576,717	53,831,157

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	31,628,014	36,538,981
運用受託報酬	5,649,190	8,362,118
投資助言報酬	1,726,511	1,440,233
その他営業収益		
情報提供コンサルタント		
業務報酬	5,000	5,000
サービス支援手数料	61,268	128,324
その他	54,261	55,820
営業収益計	39,124,246	46,530,479
営業費用		
支払手数料	14,908,517	16,961,384
広告宣伝費	366,227	353,971
公告費	1,140	1,140
調査費		
調査費	1,325,978	1,654,233
委託調査費	4,343,104	5,972,473
営業雑経費		
通信費	46,030	40,066
印刷費	338,254	339,048
協会費	21,669	-
諸会費	20,054	45,465
情報機器関連費	2,516,497	2,582,734
販売促進費	24,896	34,333
その他	149,177	136,669
営業費用合計	24,061,549	28,121,520

一般管理費			
給料			
役員報酬		225,885	196,529
給料・手当		6,121,741	6,190,716
賞与		610,533	601,375
賞与引当金繰入額		989,925	1,566,810
交際費		23,136	25,709
事務委託費		317,928	256,413
旅費交通費		229,248	220,569
租税公課		268,527	282,036
不動産賃借料		622,662	654,286
退職給付費用		423,954	419,884
固定資産減価償却費		384,068	329,756
諸経費		335,840	285,490
一般管理費合計		10,553,451	11,029,580
営業利益		4,509,246	7,379,378
営業外収益			
受取配当金	1	106,651	51,335
受取利息	1	745	520
時効成立分配金・償還金		1,721	2,622
原稿・講演料		1,474	894
雑収入		12,592	10,669
営業外収益合計		123,184	66,042
営業外費用			
為替差損		9,737	5,125
雑損失		1,084	913
営業外費用合計		10,821	6,038
経常利益		4,621,608	7,439,383
特別利益			
投資有価証券償還益		353,462	61,842
投資有価証券売却益		2,579	30,980
特別利益合計		356,041	92,822
特別損失			
固定資産除却損	2	8,157	354,695
投資有価証券償還損		43,644	141,666
投資有価証券売却損		15,012	9,634
ゴルフ会員権売却損		3,894	-
事務所移転費用		21,175	-
特別損失合計		91,884	505,996
税引前当期純利益		4,885,765	7,026,209
法人税、住民税及び事業税		1,391,996	2,350,891
法人税等調整額		25,454	280,166
法人税等合計		1,366,541	2,070,725
当期純利益		3,519,223	4,955,483

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本
--	------

	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999
当期変動額									
剰余金の配当							2,010,960	2,010,960	2,010,960
当期純利益							3,519,223	3,519,223	3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,508,263	1,508,263	1,508,263
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	517,775	517,775	34,952,774
当期変動額			
剰余金の配当			2,010,960
当期純利益			3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	190,658	190,658	190,658
当期変動額合計	190,658	190,658	1,317,604
当期末残高	327,116	327,116	36,270,379

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263
当期変動額									
剰余金の配当							1,887,480	1,887,480	1,887,480
当期純利益							4,955,483	4,955,483	4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,068,003	3,068,003	3,068,003
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078	28,382,283	39,011,267

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	327,116	327,116	36,270,379
当期変動額			
剰余金の配当			1,887,480

当期純利益			4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	870,535	870,535	39,881,802

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

償却原価法

(2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

(3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	3～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち、当事業年度の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	291,976千円	312,784千円
器具備品	651,918千円	768,929千円

2 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。

当事業年度末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	-千円	-千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	256,031千円	204,923千円

(損益計算書関係)

1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
受取配当金	106,640千円	-千円
受取利息	18千円	-千円

2 固定資産除却損

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	6,952千円	-千円
器具備品	1,204千円	0千円
ソフトウェア	-千円	9,000千円
ソフトウェア仮勘定	-千円	345,695千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度になるもの

平成29年6月27日開催の第32回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度になるもの

平成30年6月26日開催の第33回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
1年以内	626,698	208,187
1年超	191,491	42,916
合計	818,190	251,104

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融サービス事業を行っています。そのため、資金運用については、短

期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

営業債権である未収運用受託報酬及び未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されています。未収委託者報酬は、信託財産中から支弁されるものであり、信託財産については受託者である信託銀行において分別管理されているため、リスクは僅少となっています。

投資有価証券については、主に事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、主に全額出資の子会社の株式及び50%出資した関連会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

当社は、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、営業債権について、取引先毎の期日管理及び残高管理を行うとともに、その状況について取締役会に報告しています。

投資有価証券、子会社株式及び関連会社株式は発行体の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

長期差入保証金についても、差入先の信用リスクについて、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、定期的に管理を行い、その状況について取締役会に報告しています。

市場リスクの管理

投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、企画部においては総合的なリスク管理を行い、定期的に時価を把握しています。また、資産の自己査定及び償却・引当規程に従い、その状況について取締役会に報告しています。

なお、事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等については、純資産額に対する保有制限を設けており、また、自社設定投信等の取得・処分に関する規則に従い、定期的に取締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることがあります。

2.金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（（注2）参照）。

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	13,279,384	13,279,384	-
(2)顧客分別金信託	20,008	20,008	-
(3)未収委託者報酬	5,511,715	5,511,715	-
(4)未収運用受託報酬	1,297,104	1,297,104	-
(5)未収投資助言報酬	343,523	343,523	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	12,098,074	12,098,074	-
(7)長期差入保証金	677,681	677,681	-
資産計	33,227,492	33,227,492	-

(1)顧客からの預り金	304	304	-
(2)未払手数料	2,424,318	2,424,318	-
負債計	2,424,622	2,424,622	-

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	20,873,870	20,873,870	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	6,332,203	6,332,203	-
(4)未収運用受託報酬	1,725,215	1,725,215	-
(5)未収投資助言報酬	316,407	316,407	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,616,296	10,616,296	-
(7)長期差入保証金	658,505	658,505	-
資産計	40,542,507	40,542,507	-
(1)顧客からの預り金	84	84	-
(2)未払手数料	2,783,763	2,783,763	-
負債計	2,783,847	2,783,847	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬、及び(5)未収投資助言報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

(6)投資有価証券

これらの時価について、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

(7)長期差入保証金

これらの時価については、敷金の性質及び賃貸借契約の期間から帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

負 債

(1)顧客からの預り金、(2)未払手数料

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっています。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品の貸借対照表計上額

（単位：千円）

	前事業年度 （平成29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
その他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,412,523
合計	10,412,523	10,412,523

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6)その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額
前事業年度（平成29年3月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	13,279,384	-	-	-
顧客分別金信託	20,008	-	-	-
未収委託者報酬	5,511,715	-	-	-
未収運用受託報酬	1,297,104	-	-	-
未収投資助言報酬	343,523	-	-	-
長期差入保証金	31,201	646,480	-	-
合計	20,482,937	646,480	-	-

当事業年度（平成30年3月31日）

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,873,870	-	-	-
顧客分別金信託	20,010	-	-	-
未収委託者報酬	6,332,203	-	-	-
未収運用受託報酬	1,725,215	-	-	-
未収投資助言報酬	316,407	-	-	-
長期差入保証金	602,360	56,144	-	-
合計	29,870,067	56,144	-	-

(有価証券関係)

1.子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成29年3月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式10,412,523千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成30年3月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式10,412,523千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2.その他有価証券

前事業年度（平成29年3月31日）

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	4,921,829	4,267,927	653,902
小計	4,921,829	4,267,927	653,902
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	7,176,244	7,358,662	182,417
小計	7,176,244	7,358,662	182,417
合計	12,098,074	11,626,589	471,485

(注)非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,366,669	6,046,232	1,320,437
小計	7,366,669	6,046,232	1,320,437
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,249,626	3,315,328	65,701
小計	3,249,626	3,315,328	65,701
合計	10,616,296	9,361,560	1,254,735

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

3.事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
228,204	2,579	15,012

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
532,099	30,980	9,634

(退職給付関係)

1.採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2.確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,028,212	3,177,131
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の発生額	15,494	51,212
退職給付の支払額	116,111	94,727
退職給付債務の期末残高	3,177,131	3,319,830

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

（単位：千円）

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,177,131	3,319,830
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

（単位：千円）

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の費用処理額	15,494	51,212
その他	158,924	182,458
確定給付制度に係る退職給付費用	423,954	419,884

(注)その他は、その他の関係会社等からの出向者の年金掛金負担分及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額になります。

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
割引率	0.092%	0.000%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度137,310千円、当事業年度147,195千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位:千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	308,929	461,521
調査費	79,381	90,509
未払金	45,745	59,821
未払事業税	46,406	102,103
その他	2,071	2,032
繰延税金資産合計	482,535	715,988
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	972,837	1,016,532
ソフトウェア償却	18,718	11,289
賞与引当金	12,299	30,534
投資有価証券評価損	95	95
その他	14,592	6,805
繰延税金資産小計	1,018,544	1,065,256
評価性引当額	2,597	2,597
繰延税金資産合計	1,015,946	1,062,659
繰延税金負債		

その他有価証券評価差額金	144,368	384,200
繰延税金負債合計	144,368	384,200
繰延税金資産の純額	1,354,113	1,394,447

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
法定実効税率	30.8%	30.8%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.1	-
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.2
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.8	-
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	2.2	1.9
その他	0.0	0.1
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9	29.4

(セグメント情報等)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	31,628,014	5,649,190	1,726,511	120,529	39,124,246

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. セグメント情報

当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。

従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	36,538,981	8,362,118	1,440,233	189,145	46,530,479

(2) 地域ごとの情報

営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 子会社及び関連会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
子会社	SumitomoMitsui AssetManagement (HongKong)Limited	Hong Kong	5,000,000 (ホンコン ドル)	投資運 用業	% (所有) 直接100	投信の助 言業務 役員の 兼任	剰余金 の配当	106,640	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等
受取配当金については、剰余金の分配可能額を基礎とした一定の基準に基づき合理的に決定しております。

(2) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,737,677	未払 手数料	489,567
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託	委託販売 手数料	5,485,934	未払 手数料	862,697

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。
3. ㈱三井住友銀行の属性が、平成28年7月29日付で、「その他の関係会社」より「親会社」、平成28年10月1日付で「親会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社」及び「親会社」であった期間の取引金額が含まれております。
4. SMBC日興証券㈱の属性が、平成28年10月1日付で、「その他の関係会社の子会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社の子会社」であった期間の取引金額が含まれております。

2. 親会社に関する注記
株式会社三井住友フィナンシャルグループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,761,066	未払 手数料	429,436
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,685,815	未払 手数料	953,752

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記
株式会社三井住友フィナンシャルグループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1株当たり純資産額	2,056,143.98円	2,260,873.18円
1株当たり当期純利益金額	199,502.47円	280,923.11円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	3,519,223	4,955,483
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	3,519,223	4,955,483
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

(重要な後発事象)

前事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する主要株主間での基本合意について

平成30年5月11日付で当社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主である株式会社三井住友フィナンシャルグループ、株式会社大和証券グループ本社、三井住友海上火災保険株式会社及び住友生命保険相互会社が、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結しました。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
- ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
- ホ 上記ハ、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項

該当ありません。

- 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
(ロ) 資本金の額 342,037百万円(2018年3月末現在)
(ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

[参考情報：再信託受託会社の概要]

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2018年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
あかつき証券株式会社	3,067百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
いちよし証券株式会社	14,577百万円	
エイチ・エス証券株式会社	3,000百万円	
株式会社SBI証券	48,323百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
極東証券株式会社	5,251百万円	
PWM日本証券株式会社	3,000百万円	
フィリップ証券株式会社	950百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
むさし証券株式会社	5,000百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社関西アーバン銀行	47,039百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社筑波銀行	48,868百万円	
株式会社富山銀行	6,730百万円	
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	
株式会社みなと銀行	27,484百万円	
信金中央金庫	690,998百万円	信用金庫法に基づき、信用金庫連合会の事業を営んでいます。

資本金の額は、2018年3月末現在。

信金中央金庫の資本金の額の箇所には、出資の総額を記載しております。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書(目論見書)の提供、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

3【資本関係】

該当ありません。

第3【その他】

- 1．目論見書の表紙等にロゴ・マーク、写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマーク、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。
- 2．目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。
- 3．目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- 4．目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
- 5．有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
- 6．目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
- 7．評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
- 8．有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。このため、有価証券届出書に他のファンドの情報を合わせて記載することがあります。
- 9．当ファンドとスイッチング対象ファンドにかかる投資信託説明書（交付目論見書）を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成30年6月14日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤陽一	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	池ヶ谷正	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、平成30年5月11日付で会社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主が、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注)1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2. XBR Lデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成30年1月9日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド（旧名称：三井住友・DC日本株式インデックスファンドS）の平成28年12月1日から平成29年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド（旧名称：三井住友・DC日本株式インデックスファンドS）の平成29年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三井住友アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年7月10日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンドの平成29年12月1日から平成30年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンドの平成30年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年12月1日から平成30年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

三井住友アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。 2 . X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。