

## 【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】	令和1年8月28日提出
【発行者名】	三井住友D S 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】	土屋 裕子
【電話番号】	03-5405-0784
【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】	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D S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	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）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】

2019年8月29日から2020年2月27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（<https://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D S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」

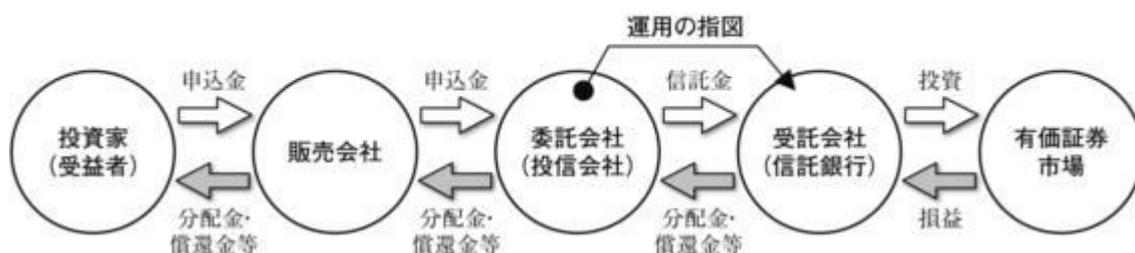
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

（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。

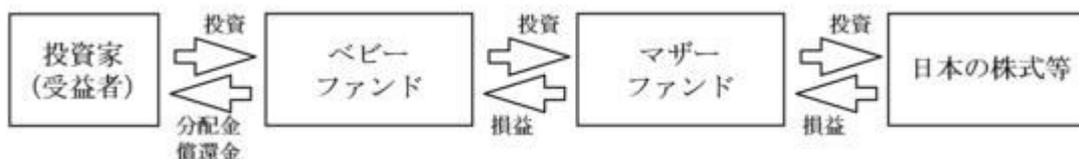
委託会社は販売会社としての役割も有します。

### 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

20億円（2019年6月28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
- 2019年 4月 1日 大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

### (ハ) 大株主の状況

（2019年6月28日現在）

名称	住所	所有 株式数 (株)	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	16,977,897	50.1
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
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	5,080,509	15.0
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	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

## 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せん。)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。

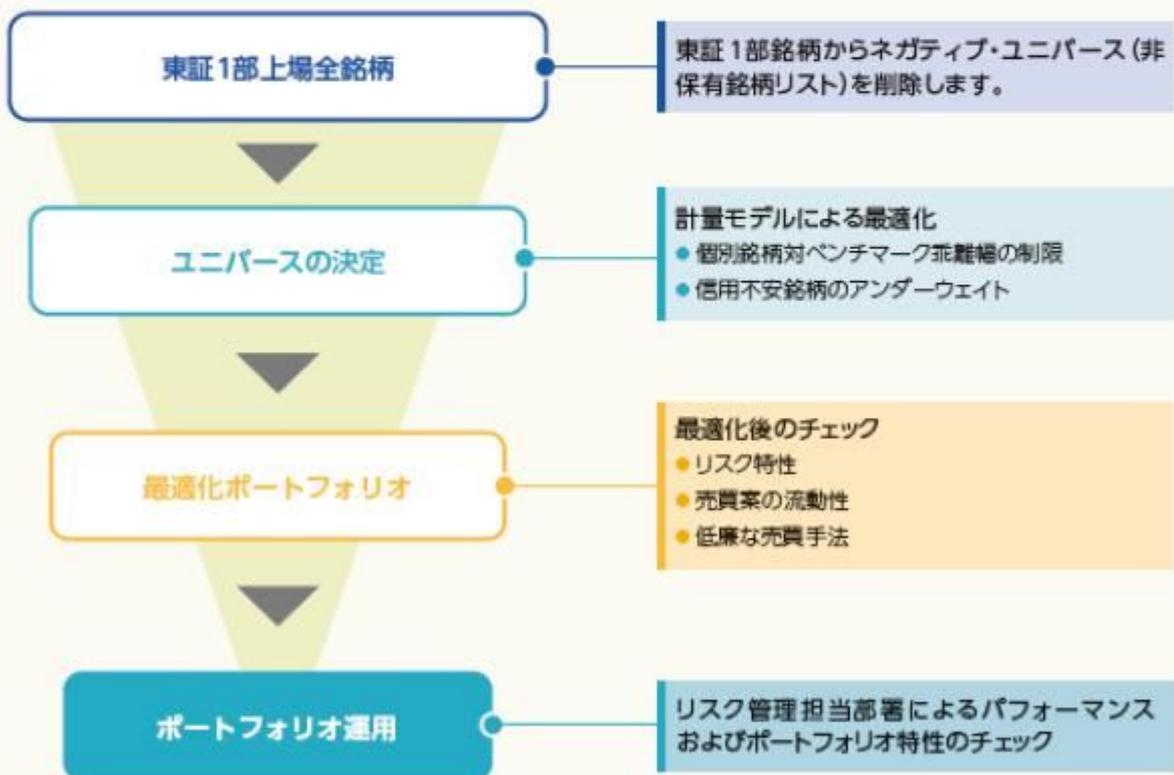
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## 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

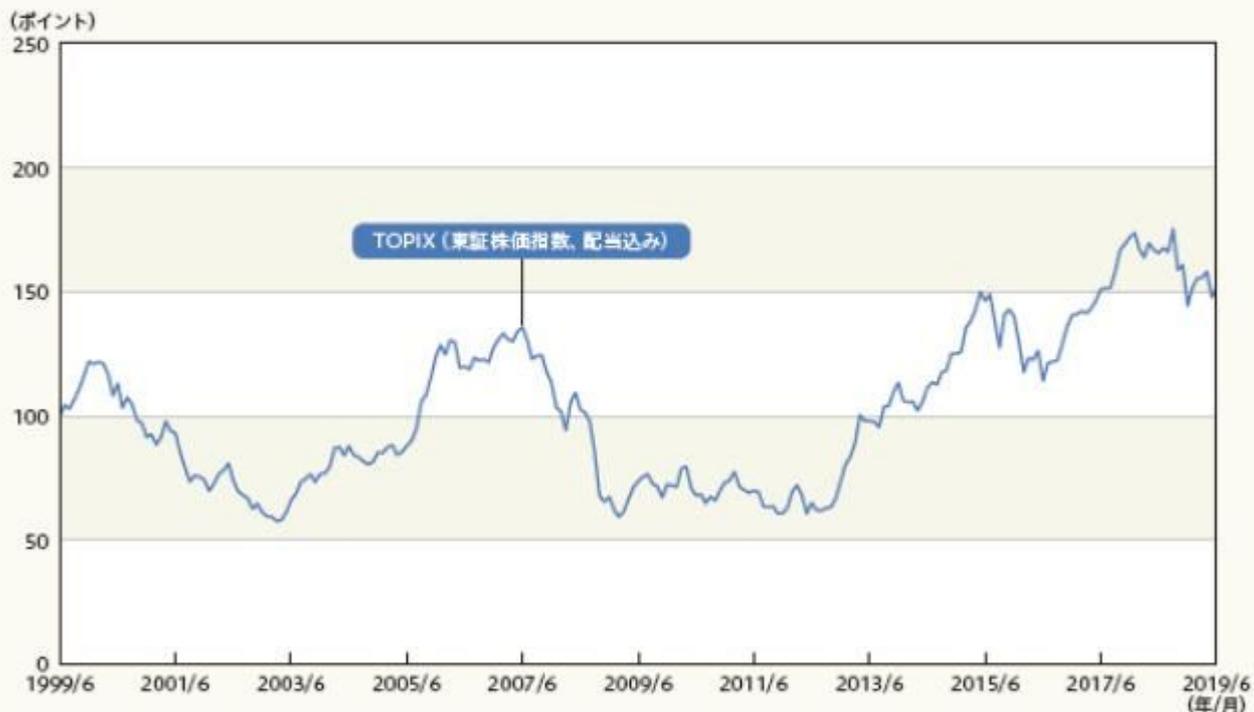


### 最適化(法)とは

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インデックス構成銘柄の一部を抽出してポートフォリオを構築する方法です。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))の推移を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1999年6月末～2019年6月末。1999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せん。)
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せん。)
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。

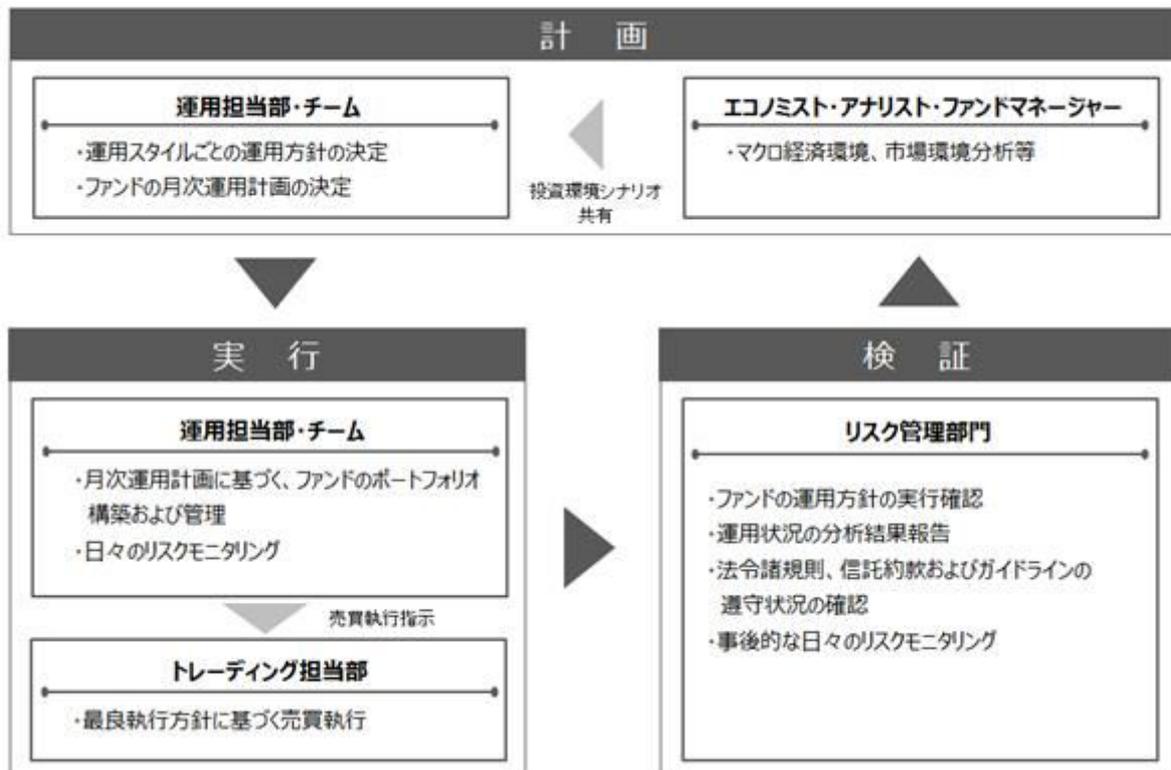
#### 八 投資対象とする金融商品

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 ファンドの運用体制



リスク管理部門の人員数は、約50名です。

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。  
上記の運用体制は、2019年4月1日現在のものです。

- ロ 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) 【配分方針】

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。
- ロ 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。）。
- ロ 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。

- (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。

八 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。

(ハ)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、T O P I X（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

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、リスク管理部において信託約款等に定める各種投資制限・リスク指標のモニタリング等、コンプライアンス部において法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行っています。当該モニタリングおよび確認結果等は、運用評価会議、リスク管理会議およびコンプライアンス会議に報告されます。

## （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) 野村証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・ダイバースファイド(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%<sup>\*</sup>（税抜き0.16%）の率を乗じて得た金額が、毎日信託財産の費用として計上され、ファンドの基準価額に反映されます。また、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。

\* 消費税率が10%となった場合は年0.176%となります。

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%<sup>\*</sup>（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。  
\* 消費税率が10%となった場合は年0.0055%となります。
- 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。

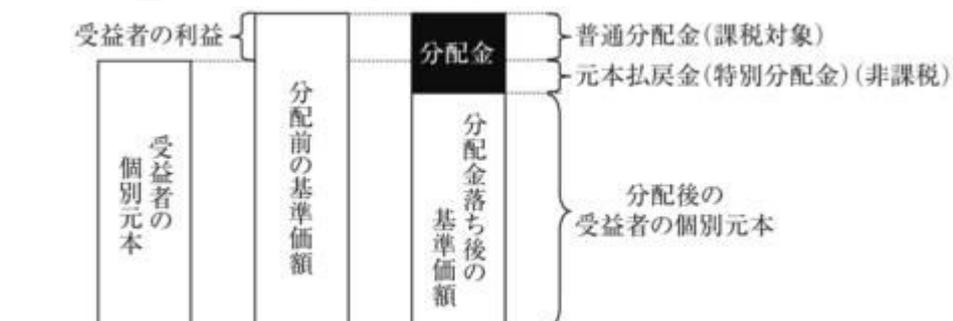
## ハ 収益分配金の課税について

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 <b>20</b> 年間 (投資期間は2037年まで)	最長 <b>5</b> 年間 (投資期間は2023年まで)	
利用できる 限度額	<b>40</b> 万円/年 (最大 <b>800</b> 万円)	<b>120</b> 万円/年 (最大 <b>600</b> 万円)	<b>80</b> 万円/年 (最大 <b>400</b> 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、2019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

2019年 6月28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	24,246,325,766	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,278,273	0.01
合計(純資産総額)		24,243,047,493	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

2019年 6月28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)	9,898,075,509	2.5598	25,337,408,199	2.4496	24,246,325,766	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

2019年 6月28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
第7期 (2018年11月30日)	19,432,679,965	19,432,679,965	25,384	25,384
2018年 6月末日	15,105,934,708		26,117	
7月末日	16,064,566,867		26,452	
8月末日	16,863,727,431		26,182	
9月末日	18,966,920,679		27,664	
10月末日	18,206,844,972		25,051	
11月末日	19,432,679,965		25,384	
12月末日	18,288,989,660		22,779	
2019年 1月末日	20,197,165,437		23,895	
2月末日	21,482,574,109		24,514	
3月末日	22,250,808,140		24,532	
4月末日	23,216,876,710		24,936	

5月末日	22,620,590,549		23,312	
6月末日	24,243,047,493		23,943	

## 【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
第7期	2017年12月1日～2018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	5.0
第8期(中間期)	8.2

(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基準価額を控除した額を前期末分配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	5,251,030,945	1,172,961,790
第8期(中間期)	2,781,424,696	733,421,769

(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)

2019年 6月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	163,460,197,680	97.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,758,648,134	2.25
合計(純資産総額)		167,218,845,814	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	3,768,930,000	2.25
合計	買建	-	3,768,930,000	2.25

(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)

2019年 6月28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	818,800	6,793.06	5,562,157,528	6,688.00	5,476,134,400	3.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	602,800	4,742.05	2,858,507,740	5,165.00	3,113,462,000	1.86

日本	株式	ソニー	電気機器	493,000	5,908.12	2,912,703,160	5,648.00	2,784,464,000	1.67
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,988,600	621.54	3,100,614,444	512.00	2,554,163,200	1.53
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	492,900	4,674.36	2,303,992,044	5,017.00	2,472,879,300	1.48
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	641,600	4,375.58	2,807,372,128	3,823.00	2,452,836,800	1.47
日本	株式	キーエンス	電気機器	36,100	61,470.28	2,219,077,108	66,130.00	2,387,293,000	1.43
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	510,800	4,165.83	2,127,905,964	3,806.00	1,944,104,800	1.16
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	502,800	3,110.80	1,564,110,240	3,594.00	1,807,063,200	1.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	619,500	3,191.16	1,976,923,620	2,785.00	1,725,307,500	1.03
日本	株式	任天堂	その他製品	42,100	34,404.96	1,448,448,816	39,490.00	1,662,529,000	0.99
日本	株式	KDDI	情報・通信業	592,700	2,661.02	1,577,186,554	2,743.50	1,626,072,450	0.97
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,833,600	187.62	1,844,980,032	156.10	1,535,024,960	0.92
日本	株式	花王	化学	178,400	8,353.92	1,490,339,328	8,210.00	1,464,664,000	0.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	507,500	3,063.22	1,554,584,150	2,840.00	1,441,300,000	0.86
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	65,800	23,330.78	1,535,165,324	21,580.00	1,419,964,000	0.85
日本	株式	ダイキン工業	機械	100,200	12,578.07	1,260,322,614	14,065.00	1,409,313,000	0.84
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	259,000	5,591.31	1,448,149,290	5,399.00	1,398,341,000	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	69,800	19,290.84	1,346,500,632	19,930.00	1,391,114,000	0.83
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	130,600	10,308.09	1,346,236,554	10,080.00	1,316,448,000	0.79
日本	株式	日立製作所	電気機器	330,600	3,281.62	1,084,903,572	3,949.00	1,305,539,400	0.78
日本	株式	日本電産	電気機器	88,400	15,023.20	1,328,050,880	14,725.00	1,301,690,000	0.78
日本	株式	信越化学工業	化学	126,900	10,077.65	1,278,853,785	10,035.00	1,273,441,500	0.76
日本	株式	キヤノン	電気機器	394,900	3,213.04	1,268,829,496	3,146.00	1,242,355,400	0.74
日本	株式	HOYA	精密機器	148,100	6,891.11	1,020,573,391	8,254.00	1,222,417,400	0.73
日本	株式	資生堂	化学	146,000	7,217.74	1,053,790,040	8,121.00	1,185,666,000	0.71
日本	株式	第一三共	医薬品	210,300	4,151.47	873,054,141	5,635.00	1,185,040,500	0.71
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	455,800	2,621.85	1,195,039,230	2,512.50	1,145,197,500	0.68
日本	株式	村田製作所	電気機器	231,300	5,745.85	1,329,015,105	4,840.00	1,119,492,000	0.67
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	303,300	4,933.32	1,496,275,956	3,648.00	1,106,438,400	0.66

## □ 種類別・業種別の投資比率

2019年 6月28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	0.27
		建設業	2.74
		食料品	4.02
		繊維製品	0.64
		パルプ・紙	0.28
		化学	7.24

医薬品	5.37
石油・石炭製品	0.61
ゴム製品	0.76
ガラス・土石製品	0.85
鉄鋼	0.89
非鉄金属	0.76
金属製品	0.54
機械	5.06
電気機器	13.29
輸送用機器	7.66
精密機器	2.08
その他製品	2.12
電気・ガス業	1.63
陸運業	4.62
海運業	0.16
空運業	0.53
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	8.70
卸売業	4.85
小売業	4.45
銀行業	5.73
証券、商品先物取引業	0.75
保険業	2.24
その他金融業	1.10
不動産業	2.37
サービス業	5.16
合計	97.75

## 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）

2019年 6月28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	243	日本円	3,763,297,440	3,768,930,000	2.25

(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: 2019年6月28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
2018年11月	0円
2017年11月	0円
2016年11月	0円
2015年11月	0円
2014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	97.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.25
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.25%

##### 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	3.27
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.86
日本	株式	ソニー	電気機器	1.67
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.53
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.48
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.47
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.43
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.16
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.08
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1.03

※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。

※2019年の収益率は、年初から2019年6月28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に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	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

お問い合わせは、午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)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。

ご購入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。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の換金申込みに制限を設ける場合があります。

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	ホームページ
--------	------	--------

三井住友DSアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>
----------------------	--------------	---

お問い合わせは、午前9時～午後5時(土、日、祝・休日を除く)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、当ファンドの知れ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、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れ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。

- (八) 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、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れ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であっても、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。

## ニ 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け付け、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。

## ヘ 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。

<https://www.smd-am.co.jp>

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依り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、持分に依り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、)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7期(平成29年12月1日から平成30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6期 (平成29年11月30日現在)	第7期 (平成30年11月30日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	1,531,711	10,914,427
コール・ローン	36,067,647	1,993,973
親投資信託受益証券	9,567,976,252	19,447,754,414
流動資産合計	9,605,575,610	19,460,662,814
<b>資産合計</b>	9,605,575,610	19,460,662,814
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	37,587,190	12,906,469
未払受託者報酬	964,366	1,827,135
未払委託者報酬	5,730,821	12,789,852
未払利息	105	5
その他未払費用	191,378	459,388
流動負債合計	44,473,860	27,982,849
<b>負債合計</b>	44,473,860	27,982,849
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	3,577,531,089	7,655,600,244
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	5,983,570,661	11,777,079,721
元本等合計	9,561,101,750	19,432,679,965
<b>純資産合計</b>	9,561,101,750	19,432,679,965
<b>負債純資産合計</b>	9,605,575,610	19,460,662,814

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第6期		第7期	
	自 至	平成28年12月 1日 平成29年11月30日	自 至	平成29年12月 1日 平成30年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,325,226,967		821,141,897
営業収益合計		1,325,226,967		821,141,897
営業費用				
支払利息		13,277		21,462
受託者報酬		1,577,757		3,092,141
委託者報酬		9,002,148		21,644,816
その他費用		294,941		787,528
営業費用合計		10,888,123		25,545,947
営業利益又は営業損失（ ）		1,314,338,844		846,687,844
経常利益又は経常損失（ ）		1,314,338,844		846,687,844
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,314,338,844		846,687,844
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（ ）		109,904,353		33,128,251
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,625,829,228		5,983,570,661
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,943,194,341		8,563,589,874
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		3,943,194,341		8,563,589,874
剰余金減少額又は欠損金増加額		789,887,399		1,956,521,221
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		789,887,399		1,956,521,221
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（ ）		5,983,570,661		11,777,079,721

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第7期
	自平成29年12月1日 至平成30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>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第6期	第7期
	(平成29年11月30日現在)	(平成30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	3,577,531,089口	7,655,600,244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) 2.6725円 26,725円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 2.5384円 25,384円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第6期	第7期
	自 平成28年12月 1日 至 平成29年11月30日	自 平成29年12月 1日 至 平成30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(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)ですが、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(308,931,086円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(10,315,501,518円)、および分配準備積立金(1,152,647,117円)より、分配対象収益は11,777,079,721円(1万口当たり15,383.59円)ですが、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7期
	自 平成29年12月 1日 至 平成30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>

項目	第7期 自 平成29年12月 1日 至 平成30年11月30日
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7期 (平成30年11月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>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。</p>
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

第7期（自 平成29年12月 1日 至 平成30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	815,827,658円
合計	815,827,658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7期 自 平成29年12月 1日 至 平成30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6期 （平成29年11月30日現在）	第7期 （平成30年11月30日現在）
期首元本額	1,412,943,518円	3,577,531,089円
期中追加設定元本額	2,809,793,582円	5,251,030,945円
期中一部解約元本額	645,206,011円	1,172,961,790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）	7,498,073,954	19,447,754,414	
合計		7,498,073,954	19,447,754,414	

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29年11月30日現在)	(平成30年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	100,867,335	3,283,915,460
コール・ローン	2,375,152,044	599,943,591
株式	190,034,814,150	168,579,248,010
派生商品評価勘定	22,657,360	134,774,480
未収入金	189,200	80,584,796
未収配当金	1,103,825,887	1,095,772,321
差入委託証拠金	17,655,000	26,595,000
流動資産合計	193,655,160,976	173,800,833,658
資産合計	193,655,160,976	173,800,833,658
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	834,320	2,694,840
前受金	21,890,000	132,395,000
未払金	-	1,592,960
未払解約金	607,066,570	116,111,681
未払利息	6,962	1,758
その他未払費用	58,774	263,041
流動負債合計	629,856,626	253,059,280
負債合計	629,856,626	253,059,280
純資産の部		
元本等		

	（平成29年11月30日現在）	（平成30年11月30日現在）
元本	70,854,907,568	66,912,228,971
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	122,170,396,782	106,635,545,407
元本等合計	193,025,304,350	173,547,774,378
純資産合計	193,025,304,350	173,547,774,378
負債純資産合計	193,655,160,976	173,800,833,658

## 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29年11月30日現在）	（平成30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 3,522,000,000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 2,721,200,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	70,854,907,568口	66,912,228,971口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.7242円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 27,242円)</p>	<p>1口当たり純資産額 2.5937円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 25,937円)</p>

## （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29年12月 1日 至 平成30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30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

(平成30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	4,738,480,360	-	4,870,560,000	132,079,640
	東証株価指数先物	4,738,480,360	-	4,870,560,000	132,079,640
合計		4,738,480,360	-	4,870,560,000	132,079,640

(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29年12月 1日 至 平成30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N I S A ・世界分散ファンド	892,449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)	8,293,658,882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 >	35,192,008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 >	3,593,405,593円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	4,224,570,178円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	2,707,437,600円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	9,990,760,791円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	59,777,193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 >	243,672,433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 >	1,569,299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 >	1,083,328,933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 >	64,742,845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 >	405,784,462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 >	1,167,685,548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 >	1,475,624,119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 >	3,514,768,578円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 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・V A S (適格機関投資家専用)	1,527,265,717円
S M A M ・ グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	75,601,383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 >	118,198,824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)	1,778,332,732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 >	115,908,138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 >	52,998,705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 >	23,441,238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 >	229,793,791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 >	412,464,457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 >	174,873,606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 >	123,105,106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 >	61,153,864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 >	11,244,478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 >	80,230,517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 >	1,044,312,649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 )	209,546,573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 >	21,310,839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 >	1,910,689,341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 >	292,412,489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 >	1,772,189,307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 >	477,821,118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 >	300,693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 >	192,135,872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 >	92,009,873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 >	179,002,788円
合計	70,854,907,568円

## (平成30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	70,854,907,568円
同期中における追加設定元本額	13,339,206,384円
同期中における一部解約元本額	17,281,884,981円
平成30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	10,354,216,475円
三井住友・D C 年金バランス3 0 (債券重点型)	768,941,629円
三井住友・D C 年金バランス5 0 (標準型)	3,698,515,899円
三井住友・D C 年金バランス7 0 (株式重点型)	2,692,088,576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)	180,714,188円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0 (4資産タイプ)	7,445,740円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5 (4資産タイプ)	24,782,474円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0 (4資産タイプ)	62,529,551円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5 (4資産タイプ)	87,629,751円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 0 (4資産タイプ)	51,789,894円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 5 (4資産タイプ)	131,284,628円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,987,526,237円
三井住友・D C つみたてN I S A ・ 日本株インデックスファンド	7,498,073,954円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	443,898,286円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	618,202,967円

アセットアロケーション・ファンド(成長型)	611,775,561円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	8,569,755円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	9,514,881円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	10,918,100円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	39,419,537円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	28,365,827円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	63,515,584円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	5,621,357円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	5,957,306,958円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	24,723,073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〉	514,312,458円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	3,486,172,970円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	2,450,832,018円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	9,016,678,236円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	57,327,222円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	223,654,156円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	758,842円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	978,965,161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〉	55,007,822円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	384,921,677円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	1,118,064,318円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	928,739,841円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	3,098,232,570円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,510,156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)	1,207,656,106円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	64,109,227円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	85,263,426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)	1,640,032,255円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	106,297,419円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	48,499,056円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	22,363,154円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	211,902,924円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	386,107,457円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	169,452,674円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	120,236,114円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	60,898,000円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	11,117,259円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉	78,033,493円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉	973,799,546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)	202,412,662円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2〈適格機関投資家専用〉	19,535,802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〉	1,677,781,097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〉	232,095,874円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	1,575,906,619円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	133,573,058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〉	8,319,114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〉	73,059,305円

S M A M ・ 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 >	35,005,032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 >	86,203,195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 >	20,774円
合計	66,912,228,971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	3,225.00	11,287,500	
日本水産	96,800	686.00	66,404,800	
マルハニチロ	14,000	4,105.00	57,470,000	
カネコ種苗	4,000	1,437.00	5,748,000	
サカタのタネ	11,500	3,895.00	44,792,500	
ホクト	7,900	2,019.00	15,950,100	
日鉄鉱業	2,400	5,560.00	13,344,000	
三井松島ホールディングス	4,900	1,612.00	7,898,800	
国際石油開発帝石	389,500	1,205.00	469,347,500	
石油資源開発	13,700	2,354.00	32,249,800	
K & O エナジーグループ	5,100	1,636.00	8,343,600	
ヒノキヤグループ	2,600	2,113.00	5,493,800	
ショーボンドホールディングス	7,500	8,700.00	65,250,000	
ミライト・ホールディングス	24,100	1,664.00	40,102,400	
タマホーム	7,200	1,111.00	7,999,200	
T A T E R U	12,500	394.00	4,925,000	
スペースバリューホールディングス	12,800	1,046.00	13,388,800	
安藤・間	61,700	686.00	42,326,200	
東急建設	28,400	1,145.00	32,518,000	
コムシスホールディングス	34,300	2,930.00	100,499,000	
ミサワホーム	9,300	831.00	7,728,300	
ビーアールホールディングス	10,500	397.00	4,168,500	
高松コンストラクショングループ	6,000	2,899.00	17,394,000	
東建コーポレーション	2,900	7,780.00	22,562,000	
大成建設	79,500	4,990.00	396,705,000	
大林組	239,000	1,132.00	270,548,000	
清水建設	243,600	970.00	236,292,000	
飛島建設	7,500	1,560.00	11,700,000	

長谷工コーポレーション	99,800	1,374.00	137,125,200
松井建設	10,800	853.00	9,212,400
銭高組	1,300	5,500.00	7,150,000
鹿島建設	187,000	1,571.00	293,777,000
不動テトラ	7,000	1,952.00	13,664,000
大末建設	5,400	1,190.00	6,426,000
鉄建建設	5,100	3,020.00	15,402,000
西松建設	17,800	2,618.00	46,600,400
三井住友建設	59,300	705.00	41,806,500
大豊建設	5,500	3,775.00	20,762,500
前田建設工業	57,800	1,192.00	68,897,600
奥村組	13,600	3,785.00	51,476,000
東鉄工業	9,400	3,340.00	31,396,000
浅沼組	3,200	3,475.00	11,120,000
戸田建設	93,400	764.00	71,357,600
熊谷組	11,400	3,595.00	40,983,000
北野建設	2,200	4,075.00	8,965,000
矢作建設工業	13,100	764.00	10,008,400
ピーエス三菱	11,100	711.00	7,892,100
日本ハウスホールディングス	18,300	504.00	9,223,200
大東建託	28,600	14,830.00	424,138,000
新日本建設	10,200	1,210.00	12,342,000
N I P P O	20,600	1,935.00	39,861,000
東亜道路工業	2,200	3,250.00	7,150,000
前田道路	25,200	2,230.00	56,196,000
日本道路	2,300	6,170.00	14,191,000
東亜建設工業	7,500	1,576.00	11,820,000
若築建設	5,800	1,723.00	9,993,400
東洋建設	32,300	423.00	13,662,900
五洋建設	96,400	716.00	69,022,400
世紀東急工業	14,800	674.00	9,975,200
福田組	2,800	5,410.00	15,148,000
住友林業	56,500	1,675.00	94,637,500
巴コーポレーション	16,000	451.00	7,216,000
大和ハウス工業	221,400	3,575.00	791,505,000
ライト工業	15,600	1,545.00	24,102,000
積水ハウス	245,500	1,711.00	420,050,500
日特建設	8,700	700.00	6,090,000
ユアテック	13,300	936.00	12,448,800
中電工	9,600	2,524.00	24,230,400
関電工	35,000	1,178.00	41,230,000
きんでん	52,800	1,966.00	103,804,800

東京エネシス	9,100	965.00	8,781,500
トーエネック	2,800	3,140.00	8,792,000
住友電設	6,200	2,079.00	12,889,800
日本電設工業	13,200	2,482.00	32,762,400
協和エクシオ	31,300	2,860.00	89,518,000
新日本空調	7,500	2,063.00	15,472,500
九電工	15,800	4,415.00	69,757,000
三機工業	18,200	1,221.00	22,222,200
日揮	69,000	1,658.00	114,402,000
中外炉工業	3,100	2,468.00	7,650,800
ヤマト	10,000	636.00	6,360,000
太平電業	5,500	2,790.00	15,345,000
高砂熱学工業	19,700	2,037.00	40,128,900
朝日工業社	2,300	3,330.00	7,659,000
明星工業	14,800	845.00	12,506,000
大気社	10,900	3,190.00	34,771,000
ダイダン	5,600	2,553.00	14,296,800
日比谷総合設備	7,900	1,926.00	15,215,400
東芝プラントシステム	17,000	2,483.00	42,211,000
OSJBホールディングス	40,700	338.00	13,756,600
新興プランテック	15,100	1,154.00	17,425,400
日本製粉	22,600	1,937.00	43,776,200
日清製粉グループ本社	79,900	2,385.00	190,561,500
日東富士製粉	600	5,620.00	3,372,000
昭和産業	6,300	2,837.00	17,873,100
鳥越製粉	9,100	948.00	8,626,800
中部飼料	9,200	1,405.00	12,926,000
フィード・ワン	52,400	210.00	11,004,000
日本甜菜製糖	5,300	1,967.00	10,425,100
三井製糖	5,500	3,020.00	16,610,000
日新製糖	3,800	2,385.00	9,063,000
森永製菓	18,100	4,990.00	90,319,000
中村屋	2,500	4,515.00	11,287,500
江崎グリコ	21,500	5,530.00	118,895,000
名糖産業	5,400	1,475.00	7,965,000
井村屋グループ	3,500	3,115.00	10,902,500
不二家	4,500	2,514.00	11,313,000
山崎製パン	58,500	2,383.00	139,405,500
モロゾフ	1,600	5,470.00	8,752,000
亀田製菓	4,500	5,360.00	24,120,000
寿スピリッツ	7,500	4,850.00	36,375,000
カルビー	32,700	3,760.00	122,952,000

森永乳業	14,500	3,325.00	48,212,500
六甲バター	5,500	2,383.00	13,106,500
ヤクルト本社	53,000	8,550.00	453,150,000
明治ホールディングス	50,500	8,930.00	450,965,000
雪印メグミルク	17,300	3,160.00	54,668,000
プリマハム	9,900	2,156.00	21,344,400
日本ハム	30,700	4,210.00	129,247,000
丸大食品	8,000	2,021.00	16,168,000
S Foods	6,400	4,905.00	31,392,000
伊藤ハム米久ホールディングス	40,600	755.00	30,653,000
サッポロホールディングス	26,300	2,585.00	67,985,500
アサヒグループホールディングス	150,100	4,754.00	713,575,400
キリンホールディングス	324,100	2,665.00	863,726,500
宝ホールディングス	53,900	1,447.00	77,993,300
オエノンホールディングス	24,800	386.00	9,572,800
養命酒製造	3,200	2,423.00	7,753,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	54,700	3,250.00	177,775,000
サントリー食品インターナショナル	47,500	4,760.00	226,100,000
ダイドーグループホールディングス	3,900	6,180.00	24,102,000
伊藤園	23,700	5,210.00	123,477,000
キーコーヒー	6,900	2,149.00	14,828,100
日清オイリオグループ	9,000	3,520.00	31,680,000
不二製油グループ本社	17,500	3,630.00	63,525,000
かどや製油	1,000	5,840.00	5,840,000
J - オイルミルズ	3,600	4,050.00	14,580,000
キッコーマン	47,100	6,620.00	311,802,000
味の素	158,300	1,962.50	310,663,750
キューピー	39,900	2,756.00	109,964,400
ハウス食品グループ本社	27,100	4,025.00	109,077,500
カゴメ	28,600	3,315.00	94,809,000
焼津水産化学工業	7,700	1,092.00	8,408,400
アリアケジャパン	6,400	9,810.00	62,784,000
ニチレイ	37,100	3,205.00	118,905,500
東洋水産	36,600	3,890.00	142,374,000
イトアンド	3,600	1,771.00	6,375,600
日清食品ホールディングス	30,200	7,330.00	221,366,000
永谷園ホールディングス	4,600	2,787.00	12,820,200
一正蒲鉾	3,300	1,096.00	3,616,800
フジッコ	7,800	2,494.00	19,453,200
ロック・フィールド	7,600	1,687.00	12,821,200
日本たばこ産業	413,600	2,823.50	1,167,799,600
ケンコーマヨネーズ	4,500	2,300.00	10,350,000

わらべや日洋ホールディングス	5,100	1,957.00	9,980,700
なとり	5,500	1,875.00	10,312,500
ピクルスコーポレーション	2,300	2,256.00	5,188,800
北の達人コーポレーション	28,900	525.00	15,172,500
ユーグレナ	29,400	698.00	20,521,200
ミヨシ油脂	3,500	1,278.00	4,473,000
理研ビタミン	3,600	3,870.00	13,932,000
片倉工業	10,000	1,218.00	12,180,000
グンゼ	5,100	4,455.00	22,720,500
東洋紡	30,300	1,643.00	49,782,900
ユニチカ	21,300	548.00	11,672,400
富士紡ホールディングス	3,900	3,110.00	12,129,000
倉敷紡績	6,700	2,900.00	19,430,000
シキボウ	6,300	1,164.00	7,333,200
日本毛織	23,000	919.00	21,137,000
ダイドーリミテッド	23,000	366.00	8,418,000
帝国繊維	8,000	2,454.00	19,632,000
帝人	56,700	1,960.00	111,132,000
東レ	543,100	890.30	483,521,930
住江織物	2,400	2,730.00	6,552,000
アツギ	8,100	1,071.00	8,675,100
ダイニック	6,200	807.00	5,003,400
セーレン	17,100	1,898.00	32,455,800
小松マテーレ	12,500	905.00	11,312,500
ワコールホールディングス	20,500	3,095.00	63,447,500
ホギメディカル	8,800	3,425.00	30,140,000
T S Iホールディングス	25,800	753.00	19,427,400
マツオカコーポレーション	2,500	3,245.00	8,112,500
ワールド	8,000	1,975.00	15,800,000
三陽商会	4,900	2,054.00	10,064,600
オンワードホールディングス	45,400	677.00	30,735,800
ゴールドウイン	6,300	11,770.00	74,151,000
デサント	17,000	2,223.00	37,791,000
特種東海製紙	4,500	4,625.00	20,812,500
王子ホールディングス	311,900	664.00	207,101,600
日本製紙	33,300	2,110.00	70,263,000
三菱製紙	14,800	586.00	8,672,800
北越コーポレーション	45,800	575.00	26,335,000
中越パルプ工業	4,000	1,599.00	6,396,000
巴川製紙所	3,100	1,140.00	3,534,000
大王製紙	33,100	1,394.00	46,141,400
レンゴー	72,100	963.00	69,432,300

トーマック	5,200	1,885.00	9,802,000
ザ・パック	5,400	3,230.00	17,442,000
クラレ	117,000	1,764.00	206,388,000
旭化成	497,500	1,243.00	618,392,500
昭和電工	46,500	4,550.00	211,575,000
住友化学	546,500	616.00	336,644,000
住友精化	3,400	4,820.00	16,388,000
日産化学	42,800	6,160.00	263,648,000
ラサ工業	3,400	1,663.00	5,654,200
クレハ	6,300	7,950.00	50,085,000
多木化学	1,100	9,670.00	10,637,000
テイカ	5,900	2,040.00	12,036,000
石原産業	13,900	1,247.00	17,333,300
日本曹達	10,900	2,708.00	29,517,200
東ソー	107,700	1,600.00	172,320,000
トクヤマ	20,400	3,110.00	63,444,000
セントラル硝子	15,800	2,798.00	44,208,400
東亜合成	44,300	1,242.00	55,020,600
大阪ソーダ	7,500	2,657.00	19,927,500
関東電化工業	16,900	944.00	15,953,600
デンカ	27,400	3,660.00	100,284,000
信越化学工業	123,200	10,135.00	1,248,632,000
日本カーバイド工業	3,200	1,937.00	6,198,400
堺化学工業	4,800	2,778.00	13,334,400
第一稀元素化学工業	6,700	1,046.00	7,008,200
エア・ウォーター	56,500	1,837.00	103,790,500
大陽日酸	57,600	1,912.00	110,131,200
日本化学工業	2,600	2,748.00	7,144,800
日本パーカライズン	38,900	1,487.00	57,844,300
高压ガス工業	12,800	887.00	11,353,600
四国化成工業	11,800	1,246.00	14,702,800
戸田工業	2,100	2,455.00	5,155,500
ステラ ケミファ	4,300	3,215.00	13,824,500
保土谷化学工業	2,900	2,589.00	7,508,100
日本触媒	11,700	7,570.00	88,569,000
大日精化工業	5,700	3,320.00	18,924,000
カネカ	18,400	4,250.00	78,200,000
三菱瓦斯化学	71,800	1,864.00	133,835,200
三井化学	63,000	2,881.00	181,503,000
J S R	70,200	1,817.00	127,553,400
東京応化工業	12,200	3,615.00	44,103,000
大阪有機化学工業	7,200	1,395.00	10,044,000

三菱ケミカルホールディングス	467,000	928.60	433,656,200
KHネオケム	10,800	3,045.00	32,886,000
ダイセル	108,400	1,270.00	137,668,000
住友ベークライト	12,200	4,120.00	50,264,000
積水化学工業	151,500	1,842.00	279,063,000
日本ゼオン	63,200	1,154.00	72,932,800
アイカ工業	21,100	3,825.00	80,707,500
宇部興産	35,200	2,587.00	91,062,400
積水樹脂	11,500	2,236.00	25,714,000
タキロンシーアイ	16,900	639.00	10,799,100
旭有機材	5,300	1,851.00	9,810,300
日立化成	32,200	1,796.00	57,831,200
ニチバン	4,100	2,262.00	9,274,200
リケンテクノス	21,800	512.00	11,161,600
大倉工業	4,400	2,153.00	9,473,200
積水化成成品工業	11,300	1,081.00	12,215,300
群栄化学工業	2,400	3,150.00	7,560,000
ダイキョーニシカワ	14,600	1,148.00	16,760,800
森六ホールディングス	4,100	3,015.00	12,361,500
日本化薬	44,400	1,495.00	66,378,000
カーリットホールディングス	9,100	922.00	8,390,200
日本精化	7,300	1,108.00	8,088,400
扶桑化学工業	7,100	2,374.00	16,855,400
トリケミカル研究所	1,700	4,490.00	7,633,000
ADEKA	34,600	1,799.00	62,245,400
日油	27,000	3,750.00	101,250,000
ハリマ化成グループ	7,300	1,168.00	8,526,400
花王	173,300	8,358.00	1,448,441,400
第一工業製薬	3,000	2,753.00	8,259,000
石原ケミカル	2,800	2,137.00	5,983,600
三洋化成工業	4,600	5,620.00	25,852,000
大日本塗料	9,300	1,121.00	10,425,300
日本ペイントホールディングス	57,600	4,025.00	231,840,000
関西ペイント	78,600	2,127.00	167,182,200
中国塗料	23,200	1,042.00	24,174,400
日本特殊塗料	5,600	1,772.00	9,923,200
藤倉化成	12,600	634.00	7,988,400
太陽ホールディングス	5,700	3,655.00	20,833,500
DIC	31,600	3,605.00	113,918,000
サカタインクス	15,200	1,353.00	20,565,600
東洋インキSCホールディングス	14,100	2,807.00	39,578,700
T&K TOKA	6,400	1,205.00	7,712,000

富士フィルムホールディングス	148,200	4,510.00	668,382,000
資生堂	141,900	7,224.00	1,025,085,600
ライオン	99,500	2,239.00	222,780,500
高砂香料工業	5,000	3,890.00	19,450,000
マンダム	15,800	3,330.00	52,614,000
ミルボン	8,900	4,920.00	43,788,000
ファンケル	31,600	2,962.00	93,599,200
コーセー	12,100	16,930.00	204,853,000
コタ	4,400	1,566.00	6,890,400
シーズ・ホールディングス	8,700	5,860.00	50,982,000
ポーラ・オルビスホールディングス	30,500	3,205.00	97,752,500
ノエビアホールディングス	4,400	5,290.00	23,276,000
エステー	5,600	2,182.00	12,219,200
アグロ カネショウ	3,300	2,468.00	8,144,400
コニシ	12,500	1,873.00	23,412,500
長谷川香料	8,700	1,568.00	13,641,600
星光P M C	6,000	916.00	5,496,000
小林製薬	20,000	7,900.00	158,000,000
荒川化学工業	7,100	1,631.00	11,580,100
メック	5,600	1,340.00	7,504,000
日本高純度化学	3,200	2,387.00	7,638,400
タカラバイオ	18,600	2,838.00	52,786,800
J C U	9,400	1,848.00	17,371,200
デクセリアルズ	18,800	991.00	18,630,800
アース製薬	5,300	5,590.00	29,627,000
北興化学工業	10,500	558.00	5,859,000
大成ラミック	3,600	3,090.00	11,124,000
クミアイ化学工業	29,700	726.00	21,562,200
日本農薬	18,600	558.00	10,378,800
アキレス	5,800	2,256.00	13,084,800
有沢製作所	12,800	821.00	10,508,800
日東電工	54,000	6,203.00	334,962,000
レック	7,800	2,058.00	16,052,400
藤森工業	6,200	3,240.00	20,088,000
前澤化成工業	7,700	1,134.00	8,731,800
J S P	4,500	2,418.00	10,881,000
エフピコ	5,800	6,930.00	40,194,000
天馬	5,400	2,087.00	11,269,800
信越ポリマー	13,700	830.00	11,371,000
東リ	23,500	297.00	6,979,500
ニフコ	28,600	2,895.00	82,797,000
バルカー	6,100	2,753.00	16,793,300

ユニ・チャーム	151,600	3,554.00	538,786,400
協和発酵キリン	88,700	2,327.00	206,404,900
武田薬品工業	281,900	4,255.00	1,199,484,500
アステラス製薬	658,000	1,744.50	1,147,881,000
大日本住友製薬	52,900	3,700.00	195,730,000
塩野義製薬	93,400	7,508.00	701,247,200
田辺三菱製薬	73,900	1,743.00	128,807,700
あすか製薬	9,400	1,230.00	11,562,000
日本新薬	18,700	7,760.00	145,112,000
中外製薬	74,100	7,770.00	575,757,000
科研製薬	13,000	5,810.00	75,530,000
エーザイ	85,500	10,415.00	890,482,500
ロート製薬	36,700	3,585.00	131,569,500
小野薬品工業	168,900	2,745.50	463,714,950
久光製薬	21,100	7,250.00	152,975,000
持田製薬	5,500	10,310.00	56,705,000
参天製薬	135,200	1,943.00	262,693,600
扶桑薬品工業	3,800	2,842.00	10,799,600
日本ケミファ	1,600	4,135.00	6,616,000
ツムラ	22,300	3,515.00	78,384,500
日医工	17,100	1,744.00	29,822,400
キッセイ薬品工業	12,800	3,510.00	44,928,000
生化学工業	14,000	1,560.00	21,840,000
栄研化学	12,600	2,605.00	32,823,000
鳥居薬品	4,100	2,630.00	10,783,000
JCRファーマ	5,100	5,810.00	29,631,000
東和薬品	3,400	8,440.00	28,696,000
富士製薬工業	5,300	1,923.00	10,191,900
沢井製薬	14,800	6,000.00	88,800,000
ゼリア新薬工業	14,200	2,104.00	29,876,800
第一三共	204,300	4,167.00	851,318,100
キョーリン製薬ホールディングス	18,300	2,728.00	49,922,400
大幸薬品	4,100	2,010.00	8,241,000
ダイト	4,300	3,420.00	14,706,000
大塚ホールディングス	136,000	5,535.00	752,760,000
大正製薬ホールディングス	15,900	13,120.00	208,608,000
ペプチドリーム	33,100	4,650.00	153,915,000
日本コークス工業	75,000	106.00	7,950,000
昭和シェル石油	66,900	1,759.00	117,677,100
ニチレキ	10,100	1,144.00	11,554,400
ユシロ化学工業	5,100	1,356.00	6,915,600
富士石油	19,700	340.00	6,698,000

MORESCO	3,800	1,664.00	6,323,200
出光興産	55,200	4,130.00	227,976,000
JXTGホールディングス	1,215,300	686.30	834,060,390
コスモエネルギーホールディングス	20,200	2,649.00	53,509,800
横浜ゴム	41,600	2,376.00	98,841,600
東洋ゴム工業	37,300	1,793.00	66,878,900
ブリヂストン	219,500	4,600.00	1,009,700,000
住友ゴム工業	64,300	1,517.00	97,543,100
オカモト	5,100	5,970.00	30,447,000
ニッタ	8,000	3,910.00	31,280,000
住友理工	14,100	1,112.00	15,679,200
三ツ星ベルト	9,600	2,461.00	23,625,600
バンドー化学	14,200	1,233.00	17,508,600
日東紡績	10,600	2,174.00	23,044,400
A G C	71,500	3,855.00	275,632,500
日本板硝子	33,500	968.00	32,428,000
日本山村硝子	4,200	1,782.00	7,484,400
日本電気硝子	30,900	3,050.00	94,245,000
オハラ	3,100	2,389.00	7,405,900
住友大阪セメント	14,600	5,100.00	74,460,000
太平洋セメント	45,000	3,840.00	172,800,000
日本ヒューム	8,900	960.00	8,544,000
日本コンクリート工業	20,500	308.00	6,314,000
三谷セキサン	3,700	2,841.00	10,511,700
アジアパイルホールディングス	11,700	694.00	8,119,800
東海カーボン	64,700	1,576.00	101,967,200
日本カーボン	3,500	5,420.00	18,970,000
東洋炭素	4,400	2,737.00	12,042,800
ノリタケカンパニーリミテド	4,300	5,630.00	24,209,000
T O T O	54,700	4,395.00	240,406,500
日本碍子	86,500	1,683.00	145,579,500
日本特殊陶業	60,000	2,332.00	139,920,000
M A R U W A	2,600	6,420.00	16,692,000
品川リフラクトリーズ	2,200	4,305.00	9,471,000
黒崎播磨	1,500	6,750.00	10,125,000
ヨータイ	7,800	686.00	5,350,800
東京窯業	12,600	466.00	5,871,600
ニッカトー	4,300	1,079.00	4,639,700
フジミインコーポレーテッド	6,400	2,436.00	15,590,400
ニチアス	19,300	2,203.00	42,517,900
ニチハ	9,900	3,105.00	30,739,500
新日鐵住金	316,000	2,076.00	656,016,000

神戸製鋼所	129,400	934.00	120,859,600
中山製鋼所	11,900	585.00	6,961,500
合同製鐵	4,100	1,946.00	7,978,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	190,700	2,001.50	381,686,050
日新製鋼	17,200	1,465.00	25,198,000
東京製鐵	37,700	978.00	36,870,600
共英製鋼	8,000	2,200.00	17,600,000
大和工業	15,200	2,968.00	45,113,600
東京鐵鋼	4,100	1,371.00	5,621,100
大阪製鐵	5,100	2,001.00	10,205,100
淀川製鋼所	9,200	2,429.00	22,346,800
丸一鋼管	25,100	3,370.00	84,587,000
モリ工業	2,700	2,716.00	7,333,200
大同特殊鋼	11,800	4,595.00	54,221,000
日本冶金工業	61,400	282.00	17,314,800
山陽特殊製鋼	8,900	2,580.00	22,962,000
愛知製鋼	3,900	3,995.00	15,580,500
日立金属	77,700	1,278.00	99,300,600
大平洋金属	5,000	3,320.00	16,600,000
新日本電工	46,400	268.00	12,435,200
栗本鐵工所	4,600	1,645.00	7,567,000
三菱製鋼	6,000	2,029.00	12,174,000
シンニッタン	14,700	413.00	6,071,100
大紀アルミニウム工業所	13,100	651.00	8,528,100
日本輕金属ホールディングス	196,200	254.00	49,834,800
三井金属鉱業	19,400	2,593.00	50,304,200
東邦亜鉛	4,000	3,830.00	15,320,000
三菱マテリアル	46,600	3,185.00	148,421,000
住友金属鉱山	97,000	3,305.00	320,585,000
D O W A ホールディングス	16,600	3,740.00	62,084,000
古河機械金属	11,800	1,439.00	16,980,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,600	2,119.00	18,223,400
東邦チタニウム	13,200	1,395.00	18,414,000
U A C J	10,500	2,377.00	24,958,500
C K サンエツ	1,700	2,760.00	4,692,000
古河電気工業	20,600	3,315.00	68,289,000
住友電気工業	264,200	1,592.50	420,738,500
フジクラ	87,200	493.00	42,989,600
タツタ電線	16,300	537.00	8,753,100
平河ヒューテック	3,600	1,324.00	4,766,400
リョービ	8,800	3,095.00	27,236,000
アーレスティ	10,200	730.00	7,446,000

アサヒホールディングス	13,400	2,351.00	31,503,400
稲葉製作所	5,700	1,357.00	7,734,900
宮地エンジニアリンググループ	2,700	2,148.00	5,799,600
トーカロ	19,600	990.00	19,404,000
アルファC o	4,000	1,395.00	5,580,000
SUMCO	78,500	1,740.00	136,590,000
川田テクノロジーズ	1,700	8,530.00	14,501,000
RS Technologies	1,600	5,040.00	8,064,000
東洋製罐グループホールディングス	44,900	2,585.00	116,066,500
ホッカンホールディングス	4,800	1,717.00	8,241,600
コロナ	5,600	1,141.00	6,389,600
横河ブリッジホールディングス	13,300	1,860.00	24,738,000
三和ホールディングス	73,200	1,378.00	100,869,600
文化シャッター	21,500	784.00	16,856,000
三協立山	10,200	1,317.00	13,433,400
アルインコ	8,900	1,099.00	9,781,100
LIXILグループ	104,200	1,471.00	153,278,200
ノーリツ	15,700	1,688.00	26,501,600
長府製作所	7,000	2,388.00	16,716,000
リンナイ	12,600	8,140.00	102,564,000
日東精工	12,500	643.00	8,037,500
岡部	15,200	990.00	15,048,000
ジーテクト	8,300	1,591.00	13,205,300
東プレ	12,800	2,312.00	29,593,600
高周波熱錬	14,400	1,024.00	14,745,600
東京製網	5,900	1,153.00	6,802,700
パイオラックス	11,200	2,780.00	31,136,000
エイチワン	8,000	1,100.00	8,800,000
日本発條	71,000	1,010.00	71,710,000
三益半導体工業	6,100	1,545.00	9,424,500
日本製鋼所	21,800	2,074.00	45,213,200
三浦工業	30,700	3,025.00	92,867,500
タクマ	25,700	1,595.00	40,991,500
ツガミ	16,100	852.00	13,717,200
オークマ	9,000	5,650.00	50,850,000
東芝機械	8,000	1,984.00	15,872,000
アマダホールディングス	107,800	1,232.00	132,809,600
アイダエンジニアリング	19,500	909.00	17,725,500
F U J I	20,600	1,493.00	30,755,800
牧野フライス製作所	8,100	4,605.00	37,300,500
オーエスジー	35,000	2,279.00	79,765,000
旭ダイヤモンド工業	19,200	702.00	13,478,400

D M G 森精機	44,900	1,590.00	71,391,000
ソディック	15,600	838.00	13,072,800
ディスコ	9,600	16,550.00	158,880,000
日東工器	4,400	2,510.00	11,044,000
日進工具	2,400	2,651.00	6,362,400
豊和工業	5,000	864.00	4,320,000
津田駒工業	2,200	2,216.00	4,875,200
島精機製作所	9,800	3,515.00	34,447,000
オプトラン	7,100	2,459.00	17,458,900
フリー	7,600	1,025.00	7,790,000
ヤマシンフィルタ	12,900	905.00	11,674,500
日阪製作所	10,100	953.00	9,625,300
やまびこ	13,700	1,298.00	17,782,600
平田機工	3,400	6,040.00	20,536,000
ペガサスミシン製造	8,600	831.00	7,146,600
ナプテスコ	39,000	3,140.00	122,460,000
三井海洋開発	7,500	2,825.00	21,187,500
レオン自動機	7,100	1,822.00	12,936,200
S M C	20,900	38,480.00	804,232,000
ホソカワミクロン	2,600	5,170.00	13,442,000
ユニオンツール	3,200	3,630.00	11,616,000
オイレス工業	9,800	1,997.00	19,570,600
日精エー・エス・ビー機械	2,300	4,065.00	9,349,500
サトーホールディングス	8,600	2,995.00	25,757,000
技研製作所	4,900	4,140.00	20,286,000
日精樹脂工業	7,300	1,021.00	7,453,300
オカダアイヨン	3,200	1,718.00	5,497,600
小松製作所	323,300	3,033.00	980,568,900
住友重機械工業	40,500	3,765.00	152,482,500
日立建機	28,500	3,135.00	89,347,500
日工	2,700	2,505.00	6,763,500
巴工業	3,700	2,366.00	8,754,200
井関農機	7,500	1,847.00	13,852,500
T O W A	7,300	741.00	5,409,300
北川鉄工所	3,700	2,573.00	9,520,100
ローツェ	3,600	1,859.00	6,692,400
クボタ	382,800	1,937.00	741,483,600
荏原実業	3,500	2,005.00	7,017,500
三菱化工機	3,900	1,731.00	6,750,900
月島機械	14,200	1,330.00	18,886,000
帝国電機製作所	5,800	1,656.00	9,604,800
新東工業	17,000	980.00	16,660,000

澁谷工業	6,300	4,135.00	26,050,500
アイチ コーポレーション	14,200	657.00	9,329,400
小森コーポレーション	19,100	1,252.00	23,913,200
鶴見製作所	6,000	1,988.00	11,928,000
住友精密工業	1,800	3,515.00	6,327,000
酒井重工業	1,800	2,694.00	4,849,200
荏原製作所	31,800	2,944.00	93,619,200
西島製作所	9,800	1,042.00	10,211,600
北越工業	8,100	1,262.00	10,222,200
ダイキン工業	97,400	12,610.00	1,228,214,000
オルガノ	3,100	3,140.00	9,734,000
トーヨーカネツ	3,100	2,414.00	7,483,400
栗田工業	38,500	3,045.00	117,232,500
椿本チエイン	9,100	4,245.00	38,629,500
大同工業	5,700	1,076.00	6,133,200
アネスト岩田	11,800	1,232.00	14,537,600
ダイフク	39,300	5,810.00	228,333,000
加藤製作所	3,900	3,035.00	11,836,500
タダノ	35,000	1,361.00	47,635,000
フジテック	25,500	1,394.00	35,547,000
C K D	19,900	1,141.00	22,705,900
キトー	6,100	1,871.00	11,413,100
平和	19,700	2,418.00	47,634,600
理想科学工業	6,200	1,938.00	12,015,600
S A N K Y O	17,900	4,540.00	81,266,000
日本金銭機械	9,000	1,128.00	10,152,000
マースグループホールディングス	5,100	2,344.00	11,954,400
福島工業	4,300	4,375.00	18,812,500
ダイコク電機	4,300	1,701.00	7,314,300
竹内製作所	11,900	2,285.00	27,191,500
アマノ	20,700	2,448.00	50,673,600
J U K I	10,200	1,515.00	15,453,000
サンデンホールディングス	9,300	880.00	8,184,000
蛇の目マシン工業	9,900	567.00	5,613,300
マックス	10,900	1,492.00	16,262,800
グローリー	19,900	2,871.00	57,132,900
新晃工業	7,400	1,650.00	12,210,000
大和冷機工業	10,300	1,314.00	13,534,200
セガサミーホールディングス	71,000	1,602.00	113,742,000
日本ピストンリング	3,500	2,086.00	7,301,000
リケン	3,300	5,660.00	18,678,000
T P R	9,400	2,699.00	25,370,600

ツバキ・ナカシマ	11,000	1,933.00	21,263,000
ホシザキ	20,800	8,810.00	183,248,000
大豊工業	6,900	1,115.00	7,693,500
日本精工	145,000	1,067.00	154,715,000
N T N	152,200	381.00	57,988,200
ジェイテクト	67,600	1,444.00	97,614,400
不二越	6,800	4,850.00	32,980,000
日本トムソン	22,300	628.00	14,004,400
T H K	44,700	2,601.00	116,264,700
ユーシン精機	6,300	1,174.00	7,396,200
前澤給装工業	4,100	1,933.00	7,925,300
イーグル工業	9,300	1,489.00	13,847,700
日本ピラー工業	8,300	1,538.00	12,765,400
キッツ	28,900	972.00	28,090,800
マキタ	86,600	4,455.00	385,803,000
日立造船	54,200	390.00	21,138,000
三菱重工業	119,700	4,317.00	516,744,900
I H I	54,800	3,455.00	189,334,000
スター精密	12,500	1,692.00	21,150,000
日清紡ホールディングス	39,600	1,033.00	40,906,800
イビデン	44,100	1,579.00	69,633,900
コニカミノルタ	156,200	1,022.00	159,636,400
ブラザー工業	92,700	1,897.00	175,851,900
ミネベアミツミ	132,300	1,842.00	243,696,600
日立製作所	321,100	3,288.00	1,055,776,800
三菱電機	713,200	1,498.00	1,068,373,600
富士電機	46,300	3,565.00	165,059,500
東洋電機製造	4,000	1,534.00	6,136,000
安川電機	82,800	3,540.00	293,112,000
シンフォニアテクノロジー	10,300	1,689.00	17,396,700
明電舎	14,200	1,606.00	22,805,200
オリジン電気	3,200	1,932.00	6,182,400
山洋電気	3,600	4,360.00	15,696,000
デンヨー	7,500	1,604.00	12,030,000
東芝テック	8,800	3,065.00	26,972,000
芝浦メカトロニクス	1,700	4,060.00	6,902,000
マブチモーター	19,600	3,955.00	77,518,000
日本電産	85,900	15,120.00	1,298,808,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,200	2,491.00	10,462,200
トレックス・セミコンダクター	3,200	1,559.00	4,988,800
東光高岳	4,400	1,582.00	6,960,800
ダブル・スコープ	10,900	1,379.00	15,031,100

ダイヘン	7,900	2,775.00	21,922,500
ヤーマン	10,600	1,871.00	19,832,600
JVCケンウッド	53,200	288.00	15,321,600
ミマキエンジニアリング	7,300	929.00	6,781,700
第一精工	3,900	1,384.00	5,397,600
日新電機	17,000	951.00	16,167,000
大崎電気工業	15,900	813.00	12,926,700
オムロン	75,700	4,990.00	377,743,000
日東工業	11,600	1,928.00	22,364,800
I D E C	9,900	2,517.00	24,918,300
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26,000	2,623.00	68,198,000
サクサホールディングス	2,700	2,017.00	5,445,900
メルコホールディングス	3,000	3,890.00	11,670,000
日本電気	92,000	3,520.00	323,840,000
富士通	68,900	6,987.00	481,404,300
沖電気工業	31,400	1,500.00	47,100,000
電気興業	4,300	2,960.00	12,728,000
サンケン電気	8,600	2,419.00	20,803,400
アイホン	5,400	1,717.00	9,271,800
ルネサスエレクトロニクス	73,000	535.00	39,055,000
セイコーエプソン	88,400	1,804.00	159,473,600
ワコム	53,000	574.00	30,422,000
アルバック	16,600	4,170.00	69,222,000
E I Z O	6,600	4,750.00	31,350,000
ジャパンディスプレイ	93,000	70.00	6,510,000
日本信号	18,300	1,012.00	18,519,600
京三製作所	18,500	505.00	9,342,500
能美防災	9,500	2,254.00	21,413,000
ホーチキ	5,300	1,313.00	6,958,900
エレコム	6,500	3,005.00	19,532,500
パナソニック	815,100	1,164.50	949,183,950
シャープ	71,100	1,684.00	119,732,400
アンリツ	45,800	1,861.00	85,233,800
富士通ゼネラル	22,300	1,603.00	35,746,900
ソニー	478,400	5,937.00	2,840,260,800
T D K	37,300	8,950.00	333,835,000
帝国通信工業	5,400	1,219.00	6,582,600
タムラ製作所	28,100	656.00	18,433,600
アルプス電気	65,300	2,631.00	171,804,300
日本トリム	1,600	6,200.00	9,920,000
ローランド ディー . ジー .	4,300	2,461.00	10,582,300
フォスター電機	8,800	1,547.00	13,613,600

クラリオン	6,200	2,490.00	15,438,000
S M K	2,600	2,552.00	6,635,200
ヨコオ	5,700	1,729.00	9,855,300
ホシデン	21,300	880.00	18,744,000
ヒロセ電機	10,300	11,970.00	123,291,000
日本航空電子工業	16,400	1,430.00	23,452,000
T O A	8,600	1,228.00	10,560,800
マクセルホールディングス	15,300	1,592.00	24,357,600
古野電気	9,700	1,292.00	12,532,400
ユニデンホールディングス	2,800	2,521.00	7,058,800
アルパイン	12,900	1,839.00	23,723,100
スミダコーポレーション	7,000	1,520.00	10,640,000
アイコム	4,400	2,352.00	10,348,800
リオン	3,800	2,032.00	7,721,600
本多通信工業	7,600	629.00	4,780,400
船井電機	10,700	747.00	7,992,900
横河電機	71,400	2,086.00	148,940,400
新電元工業	2,700	4,675.00	12,622,500
アズビル	46,200	2,450.00	113,190,000
東亜ディーケーケー	4,600	958.00	4,406,800
日本光電工業	31,600	3,695.00	116,762,000
チノー	4,500	1,481.00	6,664,500
共和電業	11,700	421.00	4,925,700
堀場製作所	14,300	5,320.00	76,076,000
アドバンテスト	49,100	2,436.00	119,607,600
エスペック	6,900	2,107.00	14,538,300
キーエンス	35,000	61,600.00	2,156,000,000
日置電機	3,900	4,240.00	16,536,000
シスメックス	55,600	6,049.00	336,324,400
日本マイクロニクス	12,900	981.00	12,654,900
メガチップス	6,000	2,749.00	16,494,000
O B A R A G R O U P	4,200	4,860.00	20,412,000
コーセル	10,900	1,160.00	12,644,000
イリソ電子工業	6,500	4,975.00	32,337,500
オブテックスグループ	12,800	2,304.00	29,491,200
千代田インテグレ	3,600	2,440.00	8,784,000
アイ・オー・データ機器	4,100	1,181.00	4,842,100
レーザーテック	14,700	3,655.00	53,728,500
スタンレー電気	50,500	3,305.00	166,902,500
岩崎電気	4,700	1,524.00	7,162,800
ウシオ電機	43,700	1,272.00	55,586,400
ヘリオス テクノ ホールディング	7,600	786.00	5,973,600

日本セラミック	7,400	2,860.00	21,164,000
古河電池	6,800	829.00	5,637,200
山一電機	5,800	1,535.00	8,903,000
図研	5,400	1,766.00	9,536,400
日本電子	14,300	1,987.00	28,414,100
カシオ計算機	63,200	1,583.00	100,045,600
ファナック	67,800	19,390.00	1,314,642,000
日本シイエムケイ	19,400	900.00	17,460,000
エンプラス	3,600	3,135.00	11,286,000
ローム	34,500	7,900.00	272,550,000
浜松ホトニクス	51,100	3,950.00	201,845,000
三井ハイテック	8,500	1,285.00	10,922,500
新光電気工業	23,700	803.00	19,031,100
京セラ	108,800	6,125.00	666,400,000
太陽誘電	32,100	2,153.00	69,111,300
村田製作所	74,900	17,315.00	1,296,893,500
ユーシン	13,900	985.00	13,691,500
双葉電子工業	11,600	1,779.00	20,636,400
ニチコン	22,900	902.00	20,655,800
日本ケミコン	5,400	2,343.00	12,652,200
K O A	11,200	1,527.00	17,102,400
市光工業	11,300	744.00	8,407,200
小糸製作所	42,500	6,090.00	258,825,000
ミツバ	14,000	747.00	10,458,000
S C R E E Nホールディングス	12,500	5,680.00	71,000,000
キャノン電子	6,500	2,143.00	13,929,500
キャノン	384,400	3,220.00	1,237,768,000
リコー	214,300	1,102.00	236,158,600
象印マホービン	13,600	1,171.00	15,925,600
東京エレクトロン	47,600	15,875.00	755,650,000
トヨタ紡織	24,900	1,749.00	43,550,100
ユニプレス	14,500	2,138.00	31,001,000
豊田自動織機	57,500	5,820.00	334,650,000
モリタホールディングス	12,500	2,238.00	27,975,000
三櫻工業	11,200	648.00	7,257,600
デンソー	158,200	5,247.00	830,075,400
東海理化電機製作所	19,000	2,085.00	39,615,000
三井E & S ホールディングス	26,400	1,231.00	32,498,400
川崎重工業	55,500	2,643.00	146,686,500
名村造船所	23,500	559.00	13,136,500
日本車輛製造	3,100	2,646.00	8,202,600
三菱ロジスネクスト	9,200	1,310.00	12,052,000

日産自動車	841,400	994.30	836,604,020	
いすゞ自動車	226,200	1,616.00	365,539,200	
トヨタ自動車	795,500	6,803.00	5,411,786,500	代用有価証券 400,000株
日野自動車	88,900	1,160.00	103,124,000	
三菱自動車工業	263,900	696.00	183,674,400	
エフテック	6,700	1,113.00	7,457,100	
武蔵精密工業	16,800	1,796.00	30,172,800	
日産車体	14,800	943.00	13,956,400	
新明和工業	33,000	1,527.00	50,391,000	
極東開発工業	14,400	1,646.00	23,702,400	
日信工業	12,800	1,504.00	19,251,200	
トピー工業	6,000	2,678.00	16,068,000	
ティラド	3,300	2,557.00	8,438,100	
タチエス	12,300	1,599.00	19,667,700	
N O K	38,500	1,710.00	65,835,000	
フタバ産業	20,300	612.00	12,423,600	
K Y B	7,600	2,827.00	21,485,200	
大同メタル工業	13,300	950.00	12,635,000	
プレス工業	35,900	613.00	22,006,700	
ミクニ	11,200	588.00	6,585,600	
太平洋工業	14,900	1,703.00	25,374,700	
ケーヒン	16,100	1,964.00	31,620,400	
河西工業	9,900	997.00	9,870,300	
アイシン精機	58,500	4,490.00	262,665,000	
マツダ	224,900	1,210.00	272,129,000	
今仙電機製作所	8,800	1,060.00	9,328,000	
本田技研工業	602,000	3,202.00	1,927,604,000	
スズキ	130,700	5,655.00	739,108,500	
S U B A R U	221,600	2,523.00	559,096,800	
安永	3,900	1,914.00	7,464,600	
ヤマハ発動機	100,500	2,335.00	234,667,500	
ショーワ	16,900	1,518.00	25,654,200	
T B K	16,500	448.00	7,392,000	
エクセディ	9,200	2,914.00	26,808,800	
豊田合成	23,200	2,185.00	50,692,000	
愛三工業	12,900	831.00	10,719,900	
日本プラスト	7,400	923.00	6,830,200	
ヨロズ	7,400	1,494.00	11,055,600	
エフ・シー・シー	12,700	2,951.00	37,477,700	
シマノ	28,700	16,580.00	475,846,000	
テイ・エス テック	16,800	3,290.00	55,272,000	
ジャムコ	3,900	3,205.00	12,499,500	

テルモ	100,700	6,685.00	673,179,500
日機装	23,200	1,132.00	26,262,400
島津製作所	91,400	2,654.00	242,575,600
JMS	12,000	595.00	7,140,000
長野計器	7,400	957.00	7,081,800
ブイ・テクノロジー	1,700	15,930.00	27,081,000
東京計器	6,000	1,109.00	6,654,000
インターアクション	4,300	2,580.00	11,094,000
東京精密	12,700	3,380.00	42,926,000
マニー	8,800	5,340.00	46,992,000
ニコン	123,900	1,780.00	220,542,000
トプコン	38,600	1,751.00	67,588,600
オリンパス	105,900	3,195.00	338,350,500
理研計器	6,400	2,376.00	15,206,400
タムロン	6,400	1,828.00	11,699,200
HOYA	143,700	6,900.00	991,530,000
シード	3,500	1,584.00	5,544,000
ノーリツ鋼機	5,800	1,955.00	11,339,000
エー・アンド・デイ	7,900	833.00	6,580,700
朝日インテック	25,600	5,320.00	136,192,000
シチズン時計	78,400	600.00	47,040,000
リズム時計工業	3,500	2,045.00	7,157,500
大研医器	8,500	765.00	6,502,500
メニコン	9,900	2,993.00	29,630,700
松風	3,200	1,233.00	3,945,600
セイコーホールディングス	11,100	2,520.00	27,972,000
ニプロ	49,900	1,543.00	76,995,700
スノーピーク	3,200	1,387.00	4,438,400
パラマウントベッドホールディングス	8,100	4,795.00	38,839,500
トランザクション	5,100	827.00	4,217,700
ニホンフラッシュ	3,600	2,080.00	7,488,000
前田工織	8,100	2,606.00	21,108,600
永大産業	16,800	449.00	7,543,200
アートネイチャー	10,700	682.00	7,297,400
バンダイナムコホールディングス	73,700	4,770.00	351,549,000
SHOEI	3,500	4,435.00	15,522,500
フランスベッドホールディングス	12,800	969.00	12,403,200
パイロットコーポレーション	12,600	5,870.00	73,962,000
萩原工業	4,700	1,710.00	8,037,000
トッパン・フォームズ	15,100	1,041.00	15,719,100
フジシールインターナショナル	15,900	4,090.00	65,031,000
タカラトミー	30,100	1,416.00	42,621,600

廣濟堂	12,000	428.00	5,136,000
プロネクサス	7,900	1,147.00	9,061,300
大建工業	5,800	2,116.00	12,272,800
凸版印刷	99,600	1,828.00	182,068,800
大日本印刷	100,000	2,626.00	262,600,000
図書印刷	8,100	830.00	6,723,000
共同印刷	3,300	2,651.00	8,748,300
N I S S H A	14,900	1,781.00	26,536,900
宝印刷	5,100	1,841.00	9,389,100
アシックス	71,000	1,636.00	116,156,000
ヤマハ	42,400	4,890.00	207,336,000
河合楽器製作所	2,500	4,030.00	10,075,000
クリナップ	9,500	725.00	6,887,500
ピジョン	43,300	4,675.00	202,427,500
キングジム	8,800	914.00	8,043,200
リンテック	17,200	2,570.00	44,204,000
イトーキ	15,800	617.00	9,748,600
任天堂	44,000	34,610.00	1,522,840,000
三菱鉛筆	11,700	2,177.00	25,470,900
タカラスタANDARD	14,300	1,778.00	25,425,400
コクヨ	34,400	1,749.00	60,165,600
ナカバヤシ	7,800	591.00	4,609,800
グローブライド	3,900	2,889.00	11,267,100
オカムラ	24,600	1,637.00	40,270,200
美津濃	7,100	2,582.00	18,332,200
東京電力ホールディングス	568,100	689.00	391,420,900
中部電力	218,200	1,702.00	371,376,400
関西電力	291,200	1,704.00	496,204,800
中国電力	97,500	1,434.00	139,815,000
北陸電力	70,100	1,011.00	70,871,100
東北電力	166,500	1,484.00	247,086,000
四国電力	64,300	1,365.00	87,769,500
九州電力	145,800	1,333.00	194,351,400
北海道電力	67,500	778.00	52,515,000
沖縄電力	13,100	2,258.00	29,579,800
電源開発	56,500	2,922.00	165,093,000
エフオン	5,200	1,022.00	5,314,400
イーレックス	12,900	693.00	8,939,700
レノバ	7,700	1,166.00	8,978,200
東京瓦斯	140,200	2,924.50	410,014,900
大阪瓦斯	139,100	2,069.00	287,797,900
東邦瓦斯	35,200	4,590.00	161,568,000

北海道瓦斯	5,000	1,504.00	7,520,000
広島ガス	20,500	361.00	7,400,500
西部瓦斯	8,100	2,498.00	20,233,800
静岡ガス	21,700	977.00	21,200,900
メタウォーター	3,800	3,185.00	12,103,000
SBSホールディングス	7,800	1,369.00	10,678,200
東武鉄道	74,800	3,250.00	243,100,000
相鉄ホールディングス	24,500	3,450.00	84,525,000
東京急行電鉄	193,500	1,976.00	382,356,000
京浜急行電鉄	97,900	1,811.00	177,296,900
小田急電鉄	113,600	2,545.00	289,112,000
京王電鉄	39,600	6,280.00	248,688,000
京成電鉄	53,300	3,680.00	196,144,000
富士急行	9,800	3,220.00	31,556,000
新京成電鉄	3,400	2,122.00	7,214,800
東日本旅客鉄道	126,900	10,320.00	1,309,608,000
西日本旅客鉄道	64,200	7,909.00	507,757,800
東海旅客鉄道	63,900	23,325.00	1,490,467,500
西武ホールディングス	91,000	2,098.00	190,918,000
鴻池運輸	11,200	1,783.00	19,969,600
西日本鉄道	20,000	2,958.00	59,160,000
ハマキョウレックス	5,500	4,205.00	23,127,500
サカイ引越センター	3,800	6,430.00	24,434,000
近鉄グループホールディングス	67,200	4,730.00	317,856,000
阪急阪神ホールディングス	90,000	3,850.00	346,500,000
南海電気鉄道	30,400	3,035.00	92,264,000
京阪ホールディングス	29,900	4,740.00	141,726,000
神戸電鉄	2,700	4,000.00	10,800,000
名古屋鉄道	53,700	2,845.00	152,776,500
山陽電気鉄道	5,600	2,363.00	13,232,800
日本通運	26,400	6,840.00	180,576,000
ヤマトホールディングス	118,800	2,998.50	356,221,800
山九	18,800	5,320.00	100,016,000
丸全昭和運輸	5,500	3,115.00	17,132,500
センコーグループホールディングス	37,200	884.00	32,884,800
トナミホールディングス	1,800	6,520.00	11,736,000
ニッコンホールディングス	25,900	2,907.00	75,291,300
福山通運	8,600	4,980.00	42,828,000
セイノーホールディングス	50,800	1,685.00	85,598,000
神奈川中央交通	2,500	3,905.00	9,762,500
日立物流	14,300	3,070.00	43,901,000
丸和運輸機関	3,600	3,355.00	12,078,000

C & F ロジホールディングス	8,600	1,300.00	11,180,000
九州旅客鉄道	56,800	3,750.00	213,000,000
S Gホールディングス	63,900	2,779.00	177,578,100
日本郵船	56,000	1,927.00	107,912,000
商船三井	39,900	2,669.00	106,493,100
川崎汽船	21,200	1,631.00	34,577,200
N S ユナイテッド海運	4,100	3,060.00	12,546,000
飯野海運	33,800	451.00	15,243,800
乾汽船	8,000	1,027.00	8,216,000
日本航空	124,100	4,094.00	508,065,400
A N Aホールディングス	124,100	4,051.00	502,729,100
トランコム	1,900	6,520.00	12,388,000
日新	6,000	1,956.00	11,736,000
三菱倉庫	23,400	2,804.00	65,613,600
三井倉庫ホールディングス	8,600	2,005.00	17,243,000
住友倉庫	26,100	1,457.00	38,027,700
澁澤倉庫	5,500	1,662.00	9,141,000
東陽倉庫	25,300	314.00	7,944,200
日本トランスシティ	19,500	492.00	9,594,000
川西倉庫	2,600	1,663.00	4,323,800
安田倉庫	8,700	875.00	7,612,500
東洋埠頭	2,400	1,559.00	3,741,600
上組	42,200	2,549.00	107,567,800
キューソー流通システム	2,300	2,509.00	5,770,700
近鉄エクスプレス	12,600	1,913.00	24,103,800
エーアイティー	5,400	1,019.00	5,502,600
N E C ネットズエスアイ	7,600	2,528.00	19,212,800
システナ	25,300	1,461.00	36,963,300
デジタルアーツ	3,900	6,490.00	25,311,000
新日鉄住金ソリューションズ	10,400	3,245.00	33,748,000
キューブシステム	6,100	771.00	4,703,100
コア	4,400	1,401.00	6,164,400
ソリトンシステムズ	5,300	906.00	4,801,800
ソフトクリエイトホールディングス	4,400	1,739.00	7,651,600
T I S	23,400	5,240.00	122,616,000
ネオス	2,900	1,335.00	3,871,500
電算システム	3,900	2,273.00	8,864,700
グリー	38,000	496.00	18,848,000
コーエーテクモホールディングス	14,400	1,884.00	27,129,600
三菱総合研究所	3,000	3,860.00	11,580,000
ファインデックス	8,100	722.00	5,848,200
ブレインパッド	1,600	7,370.00	11,792,000

K L a b	13,000	1,188.00	15,444,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	4,900	2,625.00	12,862,500
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	1,757.00	2,635,500
ネクソン	178,600	1,342.00	239,681,200
アイスタイル	18,400	1,163.00	21,399,200
エムアップ	2,700	2,203.00	5,948,100
エイチーム	4,900	1,695.00	8,305,500
テクノスジャパン	6,900	1,022.00	7,051,800
コロプラ	20,800	855.00	17,784,000
ブロードリーフ	36,300	635.00	23,050,500
デジタルハーツホールディングス	4,300	1,670.00	7,181,000
メディアドゥホールディングス	2,400	2,771.00	6,650,400
じげん	9,300	669.00	6,221,700
フィックスターズ	7,300	1,353.00	9,876,900
VOYAGE GROUP	4,800	1,264.00	6,067,200
オブティム	1,800	4,775.00	8,595,000
セレス	2,800	2,134.00	5,975,200
ティーガイア	6,900	2,422.00	16,711,800
セック	1,400	4,390.00	6,146,000
豆蔵ホールディングス	7,100	1,072.00	7,611,200
テクマトリックス	5,400	1,890.00	10,206,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	174,500	252.00	43,974,000
GMOペイメントゲートウェイ	11,600	6,990.00	81,084,000
システムリサーチ	1,200	3,605.00	4,326,000
インターネットイニシアティブ	11,600	2,792.00	32,387,200
さくらインターネット	10,500	592.00	6,216,000
ヴィンクス	2,700	1,836.00	4,957,200
GMOクラウド	2,000	4,010.00	8,020,000
SRAホールディングス	4,100	3,040.00	12,464,000
eBASE	2,900	1,729.00	5,014,100
アドソル日進	2,900	1,962.00	5,689,800
フリービット	5,800	988.00	5,730,400
コムチュア	4,200	3,325.00	13,965,000
アステリア	4,400	904.00	3,977,600
マークライنز	3,300	1,524.00	5,029,200
メディカル・データ・ビジョン	6,600	1,026.00	6,771,600
gumi	9,100	742.00	6,752,200
モバイルファクトリー	2,500	1,354.00	3,385,000
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,600	1,613.00	5,806,800
PCIホールディングス	1,700	2,794.00	4,749,800
オープンドア	3,800	3,325.00	12,635,000
アカツキ	2,600	5,540.00	14,404,000

LINE	21,600	4,080.00	88,128,000
オークネット	5,200	1,120.00	5,824,000
AOI TYO Holdings	8,300	1,050.00	8,715,000
マクロミル	9,200	1,781.00	16,385,200
オロ	900	3,805.00	3,424,500
フェイス	4,500	1,193.00	5,368,500
野村総合研究所	44,500	4,985.00	221,832,500
サイバネットシステム	7,600	676.00	5,137,600
インテージホールディングス	10,700	1,019.00	10,903,300
ソースネクスト	28,200	736.00	20,755,200
フォーカスシステムズ	6,000	1,114.00	6,684,000
クレスコ	2,400	3,850.00	9,240,000
フジ・メディア・ホールディングス	73,000	1,769.00	129,137,000
オービック	24,300	9,810.00	238,383,000
ジャストシステム	10,100	2,551.00	25,765,100
TDCソフト	7,100	973.00	6,908,300
ヤフー	457,500	325.00	148,687,500
トレンドマイクロ	37,400	6,510.00	243,474,000
日本オラクル	11,400	7,370.00	84,018,000
アルファシステムズ	2,900	2,666.00	7,731,400
フューチャー	10,100	1,753.00	17,705,300
CAC Holdings	7,700	1,074.00	8,269,800
ソフトバンク・テクノロジー	3,200	2,118.00	6,777,600
オービックビジネスコンサルタント	3,600	9,940.00	35,784,000
伊藤忠テクノソリューションズ	32,000	2,189.00	70,048,000
アイティフォー	9,900	855.00	8,464,500
大塚商会	37,900	3,820.00	144,778,000
サイボウズ	10,200	700.00	7,140,000
電通国際情報サービス	4,500	3,840.00	17,280,000
デジタルガレージ	13,900	3,105.00	43,159,500
EMシステムズ	7,200	1,172.00	8,438,400
ウェザーニューズ	3,000	3,215.00	9,645,000
C I J	9,000	753.00	6,777,000
WOWOW	3,600	3,320.00	11,952,000
スカラ	7,400	843.00	6,238,200
IMAGICA GROUP	7,400	607.00	4,491,800
ネットワンシステムズ	24,900	2,347.00	58,440,300
アルゴグラフィックス	3,100	4,540.00	14,074,000
マーベラス	12,200	917.00	11,187,400
エイベックス	12,300	1,545.00	19,003,500
日本ユニシス	21,800	2,895.00	63,111,000
兼松エレクトロニクス	3,900	3,640.00	14,196,000

東京放送ホールディングス	46,700	2,126.00	99,284,200
日本テレビホールディングス	64,400	1,777.00	114,438,800
朝日放送グループホールディングス	10,500	785.00	8,242,500
テレビ朝日ホールディングス	19,600	2,285.00	44,786,000
スカパーJ S A Tホールディングス	53,400	547.00	29,209,800
テレビ東京ホールディングス	5,800	2,750.00	15,950,000
ビジョン	2,300	4,775.00	10,982,500
コネクシオ	5,500	1,477.00	8,123,500
日本電信電話	479,100	4,680.00	2,242,188,000
K D D I	617,200	2,664.00	1,644,220,800
光通信	8,300	18,110.00	150,313,000
N T T ドコモ	503,000	2,628.50	1,322,135,500
エムティーアイ	10,200	601.00	6,130,200
G M O インターネット	25,900	1,490.00	38,591,000
カドカワ	20,600	1,411.00	29,066,600
学研ホールディングス	2,500	4,395.00	10,987,500
ゼンリン	14,100	2,817.00	39,719,700
アイネット	5,200	1,669.00	8,678,800
松竹	4,800	11,890.00	57,072,000
東宝	46,100	3,950.00	182,095,000
東映	2,900	13,800.00	40,020,000
エヌ・ティ・ティ・データ	186,500	1,320.00	246,180,000
D T S	7,700	4,090.00	31,493,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32,700	3,700.00	120,990,000
シーイーシー	7,700	2,455.00	18,903,500
カブコン	30,500	2,222.00	67,771,000
アイ・エス・ビー	1,700	2,374.00	4,035,800
ジャステック	5,800	1,065.00	6,177,000
S C S K	18,600	4,505.00	83,793,000
日本システムウエア	2,800	2,474.00	6,927,200
アイネス	10,100	1,269.00	12,816,900
T K C	5,900	4,080.00	24,072,000
富士ソフト	10,400	5,140.00	53,456,000
N S D	11,200	2,392.00	26,790,400
コナミホールディングス	28,700	5,080.00	145,796,000
福井コンピュータホールディングス	3,000	1,755.00	5,265,000
J B C C ホールディングス	6,600	1,771.00	11,688,600
ミロク情報サービス	7,300	2,450.00	17,885,000
ソフトバンクグループ	292,800	9,526.00	2,789,212,800
伊藤忠食品	1,900	5,320.00	10,108,000
エレマテック	3,800	2,261.00	8,591,800
J A L U X	2,400	2,862.00	6,868,800

あらた	4,000	4,930.00	19,720,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	1,911.00	7,261,800
フィールズ	7,800	916.00	7,144,800
双日	387,200	402.00	155,654,400
アルフレッサ ホールディングス	77,800	3,020.00	234,956,000
横浜冷凍	19,100	948.00	18,106,800
アルコニックス	8,700	1,305.00	11,353,500
神戸物産	10,600	3,480.00	36,888,000
あい ホールディングス	11,500	2,263.00	26,024,500
ダイワボウホールディングス	6,400	6,360.00	40,704,000
マクニカ・富士エレホールディングス	19,000	1,752.00	33,288,000
ラクト・ジャパン	1,600	7,960.00	12,736,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,300	1,212.00	16,119,600
八洲電機	9,000	835.00	7,515,000
U K Cホールディングス	5,200	2,436.00	12,667,200
ジュテックホールディングス	2,500	1,065.00	2,662,500
T O K A Iホールディングス	36,700	1,004.00	36,846,800
三洋貿易	4,400	2,023.00	8,901,200
ウイン・パートナーズ	5,300	1,162.00	6,158,600
シップヘルスケアホールディングス	14,500	4,270.00	61,915,000
コメダホールディングス	16,600	2,370.00	39,342,000
小野建	7,100	1,678.00	11,913,800
佐島電機	6,600	1,051.00	6,936,600
伯東	5,700	1,339.00	7,632,300
コンドーテック	8,000	1,033.00	8,264,000
ナガイレーベン	10,400	2,775.00	28,860,000
三菱食品	7,500	3,065.00	22,987,500
松田産業	6,200	1,492.00	9,250,400
第一興商	10,700	5,180.00	55,426,000
メディバルホールディングス	75,600	2,600.00	196,560,000
S P K	2,000	2,390.00	4,780,000
萩原電気ホールディングス	3,200	3,205.00	10,256,000
アズワン	5,000	8,380.00	41,900,000
尾家産業	4,100	1,336.00	5,477,600
シモジマ	4,100	1,128.00	4,624,800
ドウシシャ	6,500	2,104.00	13,676,000
高速	6,500	1,209.00	7,858,500
丸文	9,000	847.00	7,623,000
ハピネット	6,300	1,615.00	10,174,500
日本ライフライン	22,100	1,798.00	39,735,800
エクセル	3,200	2,009.00	6,428,800
マルカキカイ	3,100	2,244.00	6,956,400

I D O M	25,400	570.00	14,478,000
日本エム・ディ・エム	4,800	1,389.00	6,667,200
進和	4,800	2,430.00	11,664,000
ダイترون	3,900	1,540.00	6,006,000
シークス	9,200	1,808.00	16,633,600
オーハシテクニカ	5,700	1,398.00	7,968,600
白銅	3,500	1,772.00	6,202,000
伊藤忠商事	491,800	2,016.00	991,468,800
丸紅	693,900	847.50	588,080,250
長瀬産業	39,700	1,697.00	67,370,900
蝶理	5,400	1,894.00	10,227,600
豊田通商	77,800	3,920.00	304,976,000
三共生興	16,800	457.00	7,677,600
兼松	27,400	1,448.00	39,675,200
三井物産	579,100	1,774.50	1,027,612,950
日本紙パルプ商事	4,100	4,485.00	18,388,500
日立ハイテクノロジーズ	21,400	4,045.00	86,563,000
カメイ	9,900	1,385.00	13,711,500
スターゼン	2,700	4,390.00	11,853,000
山善	26,600	1,203.00	31,999,800
椿本興業	2,200	3,370.00	7,414,000
住友商事	415,900	1,743.50	725,121,650
内田洋行	3,900	2,701.00	10,533,900
三菱商事	493,200	3,062.00	1,510,178,400
第一実業	3,500	4,010.00	14,035,000
キャノンマーケティングジャパン	20,400	2,178.00	44,431,200
西華産業	4,800	1,647.00	7,905,600
佐藤商事	8,000	996.00	7,968,000
菱洋エレクトロ	7,800	1,798.00	14,024,400
東京産業	9,400	595.00	5,593,000
ユアサ商事	7,000	3,805.00	26,635,000
神鋼商事	2,000	2,758.00	5,516,000
阪和興業	12,400	3,400.00	42,160,000
正栄食品工業	3,800	4,840.00	18,392,000
カナデン	8,200	1,309.00	10,733,800
菱電商事	6,900	1,600.00	11,040,000
フルサト工業	5,200	1,916.00	9,963,200
岩谷産業	15,800	3,780.00	59,724,000
極東貿易	3,000	1,767.00	5,301,000
イワキ	10,800	528.00	5,702,400
三愛石油	18,600	1,298.00	24,142,800
稲畑産業	16,300	1,628.00	26,536,400

ワキタ	15,700	1,305.00	20,488,500
東邦ホールディングス	20,900	3,015.00	63,013,500
サンゲツ	21,900	2,172.00	47,566,800
ミツウロコグループホールディングス	11,900	710.00	8,449,000
シナネンホールディングス	3,600	2,749.00	9,896,400
伊藤忠エネクス	14,800	1,067.00	15,791,600
サンリオ	22,500	2,346.00	52,785,000
サンワテクノス	5,700	1,247.00	7,107,900
リョーサン	8,200	3,310.00	27,142,000
新光商事	7,400	1,757.00	13,001,800
トーホー	4,100	2,395.00	9,819,500
三信電気	6,200	2,019.00	12,517,800
東陽テクニカ	11,000	908.00	9,988,000
モスフードサービス	8,900	3,065.00	27,278,500
加賀電子	7,000	2,404.00	16,828,000
ソーダニッカ	9,900	632.00	6,256,800
立花エレテック	6,100	1,769.00	10,790,900
PALTA C	12,500	6,080.00	76,000,000
太平洋興発	5,400	887.00	4,789,800
西本Wismettacホールディングス	1,700	5,180.00	8,806,000
ヤマタネ	4,800	1,959.00	9,403,200
日鉄住金物産	4,700	5,120.00	24,064,000
泉州電業	3,000	2,669.00	8,007,000
トラスコ中山	14,300	3,225.00	46,117,500
オートバックスセブン	28,500	1,736.00	49,476,000
モリト	7,400	813.00	6,016,200
加藤産業	10,600	3,515.00	37,259,000
イノテック	5,800	1,172.00	6,797,600
イエローハット	6,700	2,983.00	19,986,100
J Kホールディングス	10,000	615.00	6,150,000
日伝	6,600	1,828.00	12,064,800
杉本商事	4,800	1,800.00	8,640,000
因幡電機産業	9,600	4,715.00	45,264,000
バイテックホールディングス	3,000	2,432.00	7,296,000
東テク	2,800	2,810.00	7,868,000
ミスミグループ本社	88,000	2,572.00	226,336,000
タキヒヨー	3,400	1,967.00	6,687,800
スズケン	32,000	6,110.00	195,520,000
ジェコス	6,500	1,154.00	7,501,000
ローソン	17,800	7,430.00	132,254,000
サンエー	5,200	4,765.00	24,778,000
カワチ薬品	6,000	2,209.00	13,254,000

エービーシー・マート	11,000	6,380.00	70,180,000
アスクル	6,100	2,965.00	18,086,500
ゲオホールディングス	10,800	1,911.00	20,638,800
アダストリア	10,000	1,859.00	18,590,000
くらコーポレーション	4,200	7,140.00	29,988,000
キャンドウ	5,100	1,684.00	8,588,400
パルグループホールディングス	3,900	3,080.00	12,012,000
エディオン	29,300	1,248.00	36,566,400
サーラコーポレーション	16,600	661.00	10,972,600
ハローズ	3,100	2,598.00	8,053,800
あみやき亭	1,900	4,100.00	7,790,000
ひらまつ	19,600	369.00	7,232,400
大黒天物産	2,000	4,485.00	8,970,000
ハニーズホールディングス	8,800	909.00	7,999,200
アルペン	6,000	1,947.00	11,682,000
クオールホールディングス	10,500	2,030.00	21,315,000
ジーンズ	4,900	7,020.00	34,398,000
ビックカメラ	37,100	1,596.00	59,211,600
D C Mホールディングス	37,000	1,126.00	41,662,000
ペッパーフードサービス	5,700	4,100.00	23,370,000
MonotaRO	44,800	3,075.00	137,760,000
D Dホールディングス	2,000	2,466.00	4,932,000
アークランドサービスホールディングス	5,500	2,514.00	13,827,000
J . フロント リテイリング	90,100	1,550.00	139,655,000
ドトール・日レスホールディングス	12,100	2,215.00	26,801,500
マツモトキヨシホールディングス	29,100	4,215.00	122,656,500
ブロンコビリー	3,900	2,981.00	11,625,900
Z O Z O	76,300	2,525.00	192,657,500
物語コーポレーション	2,100	11,070.00	23,247,000
ココカラファイン	7,800	6,480.00	50,544,000
三越伊勢丹ホールディングス	131,300	1,313.00	172,396,900
H a m e e	2,200	1,831.00	4,028,200
ウエルシアホールディングス	18,500	5,750.00	106,375,000
クリエイトSDホールディングス	10,100	3,095.00	31,259,500
チムニー	2,800	2,751.00	7,702,800
シュッピン	5,300	1,095.00	5,803,500
ネクステージ	11,000	1,199.00	13,189,000
ジョイフル本田	20,300	1,731.00	35,139,300
鳥貴族	2,900	2,242.00	6,501,800
キリン堂ホールディングス	3,400	1,615.00	5,491,000
ホットランド	5,100	1,483.00	7,563,300
すかいらーくホールディングス	65,800	1,860.00	122,388,000

綿半ホールディングス	3,100	2,717.00	8,422,700
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	19,000	1,319.00	25,061,000
あさひ	6,700	1,461.00	9,788,700
日本調剤	2,700	3,670.00	9,909,000
コスモス薬品	3,600	23,030.00	82,908,000
セブン&アイ・ホールディングス	294,500	4,943.00	1,455,713,500
薬王堂	3,100	3,400.00	10,540,000
クリエイト・レストランツ・ホールディング	18,800	1,325.00	24,910,000
ツルハホールディングス	15,300	11,200.00	171,360,000
サンマルクホールディングス	5,400	2,774.00	14,979,600
トリドールホールディングス	8,900	2,212.00	19,686,800
TOKYO BASE	7,300	696.00	5,080,800
ジャパンミート	3,100	1,988.00	6,162,800
ダイユー・リックホールディングス	5,000	1,191.00	5,955,000
パロックジャパンリミテッド	6,900	1,073.00	7,403,700
クスリのアオキホールディングス	5,500	8,400.00	46,200,000
スシローグローバルホールディングス	7,800	6,220.00	48,516,000
LIXILビバ	6,200	1,779.00	11,029,800
メディカルシステムネットワーク	9,600	460.00	4,416,000
ノジマ	12,400	2,605.00	32,302,000
カッパ・クリエイト	11,200	1,500.00	16,800,000
ライトオン	7,600	944.00	7,174,400
良品計画	10,000	30,550.00	305,500,000
三城ホールディングス	14,500	494.00	7,163,000
アドヴァン	12,300	1,099.00	13,517,700
アルビス	3,100	2,866.00	8,884,600
コナカ	13,800	497.00	6,858,600
G-7ホールディングス	2,600	2,636.00	6,853,600
イオン北海道	10,100	812.00	8,201,200
コジマ	12,800	518.00	6,630,400
コーナン商事	9,200	2,800.00	25,760,000
エコス	3,100	2,087.00	6,469,700
ワタミ	10,300	1,422.00	14,646,600
ドンキホーテホールディングス	45,600	6,890.00	314,184,000
西松屋チェーン	15,600	997.00	15,553,200
ゼンショーホールディングス	33,600	2,826.00	94,953,600
幸楽苑ホールディングス	6,200	2,241.00	13,894,200
サイゼリヤ	11,500	2,170.00	24,955,000
V Tホールディングス	26,000	469.00	12,194,000
ユナイテッドアローズ	8,100	3,825.00	30,982,500
ハイデイ日高	9,100	2,357.00	21,448,700
コロワイド	23,200	2,642.00	61,294,400

ピーシーデポコーポレーション	10,800	554.00	5,983,200
壱番屋	4,900	4,765.00	23,348,500
スギホールディングス	15,500	5,340.00	82,770,000
ヴィア・ホールディングス	11,800	731.00	8,625,800
スクロール	12,700	454.00	5,765,800
ヨンドシーホールディングス	7,900	2,465.00	19,473,500
ユニー・ファミリーマートホールディングス	19,600	16,110.00	315,756,000
木曽路	8,500	2,618.00	22,253,000
S R Sホールディングス	10,400	1,032.00	10,732,800
ケーヨー	17,000	609.00	10,353,000
上新電機	8,300	2,892.00	24,003,600
日本瓦斯	12,900	4,040.00	52,116,000
ロイヤルホールディングス	12,200	2,859.00	34,879,800
いなげや	7,700	1,582.00	12,181,400
島忠	16,100	3,065.00	49,346,500
チヨダ	7,300	2,049.00	14,957,700
ライフコーポレーション	5,200	2,708.00	14,081,600
リンガーハット	8,900	2,477.00	22,045,300
MrMaxHD	11,800	544.00	6,419,200
AOKIホールディングス	13,800	1,465.00	20,217,000
オークワ	11,000	1,248.00	13,728,000
コメリ	11,300	2,717.00	30,702,100
青山商事	13,700	2,848.00	39,017,600
しまむら	8,200	9,640.00	79,048,000
高島屋	55,400	1,650.00	91,410,000
松屋	14,900	1,414.00	21,068,600
エイチ・ツー・オー リテイリング	36,300	1,947.00	70,676,100
近鉄百貨店	3,000	3,730.00	11,190,000
パルコ	7,700	1,310.00	10,087,000
丸井グループ	59,600	2,447.00	145,841,200
アクシアル リテイリング	5,700	4,035.00	22,999,500
イオン	270,500	2,721.00	736,030,500
イズミ	14,300	6,430.00	91,949,000
平和堂	13,800	3,150.00	43,470,000
フジ	8,600	2,139.00	18,395,400
ヤオコー	7,700	6,790.00	52,283,000
ゼビオホールディングス	8,100	1,473.00	11,931,300
ケーズホールディングス	73,200	1,197.00	87,620,400
Olympicグループ	5,800	865.00	5,017,000
日産東京販売ホールディングス	17,800	347.00	6,176,600
Genky DrugStores	2,900	3,705.00	10,744,500
総合メディカルホールディングス	6,100	2,665.00	16,256,500

アインホールディングス	9,500	8,750.00	83,125,000
元気寿司	2,100	5,010.00	10,521,000
ヤマダ電機	215,500	549.00	118,309,500
アークランドサカモト	11,900	1,552.00	18,468,800
ニトリホールディングス	30,500	15,205.00	463,752,500
グルメ杵屋	8,200	1,195.00	9,799,000
吉野家ホールディングス	25,500	1,949.00	49,699,500
松屋フーズホールディングス	3,300	3,895.00	12,853,500
サガミホールディングス	10,400	1,382.00	14,372,800
関西スーパーマーケット	6,900	1,100.00	7,590,000
王将フードサービス	5,100	7,930.00	40,443,000
プレナス	7,700	1,985.00	15,284,500
ミニストップ	5,600	2,072.00	11,603,200
アークス	12,800	2,844.00	36,403,200
パローホールディングス	15,500	2,928.00	45,384,000
ベルク	3,400	6,030.00	20,502,000
大庄	5,500	1,718.00	9,449,000
ファーストリテイリング	9,400	59,040.00	554,976,000
サンドラッグ	26,400	3,830.00	101,112,000
サックスパー ホールディングス	7,300	1,124.00	8,205,200
ベルーナ	17,300	1,279.00	22,126,700
じもとホールディングス	60,300	150.00	9,045,000
めぶきフィナンシャルグループ	365,500	343.00	125,366,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,000	2,099.00	20,990,000
九州フィナンシャルグループ	113,500	531.00	60,268,500
ゆうちょ銀行	198,400	1,326.00	263,078,400
富山第一銀行	21,600	433.00	9,352,800
コンコルディア・フィナンシャルグループ	446,200	533.00	237,824,600
西日本フィナンシャルホールディングス	45,900	1,232.00	56,548,800
関西みらいフィナンシャルグループ	33,300	915.00	30,469,500
三十三フィナンシャルグループ	7,000	1,919.00	13,433,000
第四北越フィナンシャルグループ	12,200	3,700.00	45,140,000
新生銀行	50,800	1,558.00	79,146,400
あおぞら銀行	38,700	3,730.00	144,351,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,902,000	624.50	3,061,299,000
りそなホールディングス	768,800	601.90	462,740,720
三井住友トラスト・ホールディングス	137,600	4,552.00	626,355,200
三井住友フィナンシャルグループ	495,800	4,183.00	2,073,931,400
千葉銀行	247,000	745.00	184,015,000
群馬銀行	138,400	541.00	74,874,400
武蔵野銀行	10,600	3,070.00	32,542,000
千葉興業銀行	23,600	445.00	10,502,000

筑波銀行	36,800	242.00	8,905,600
七十七銀行	21,900	2,273.00	49,778,700
青森銀行	6,100	3,125.00	19,062,500
秋田銀行	5,300	2,332.00	12,359,600
山形銀行	8,200	2,387.00	19,573,400
岩手銀行	5,100	4,140.00	21,114,000
東邦銀行	63,400	376.00	23,838,400
東北銀行	5,500	1,345.00	7,397,500
みちのく銀行	5,500	1,817.00	9,993,500
ふくおかフィナンシャルグループ	56,700	2,589.00	146,796,300
静岡銀行	175,700	1,019.00	179,038,300
十六銀行	9,400	2,696.00	25,342,400
スルガ銀行	69,800	538.00	37,552,400
八十二銀行	122,900	521.00	64,030,900
山梨中央銀行	9,300	1,663.00	15,465,900
大垣共立銀行	11,000	2,490.00	27,390,000
福井銀行	6,900	1,926.00	13,289,400
北國銀行	7,800	4,250.00	33,150,000
清水銀行	3,900	1,901.00	7,413,900
富山銀行	1,700	3,780.00	6,426,000
滋賀銀行	13,900	2,848.00	39,587,200
南都銀行	8,600	2,574.00	22,136,400
百五銀行	62,900	450.00	28,305,000
京都銀行	25,000	5,460.00	136,500,000
紀陽銀行	24,800	1,808.00	44,838,400
ほくほくフィナンシャルグループ	46,300	1,484.00	68,709,200
広島銀行	101,800	684.00	69,631,200
山陰合同銀行	42,000	895.00	37,590,000
中国銀行	45,000	1,057.00	47,565,000
伊予銀行	91,400	697.00	63,705,800
百十四銀行	7,800	2,883.00	22,487,400
四国銀行	11,100	1,399.00	15,528,900
阿波銀行	11,100	3,280.00	36,408,000
大分銀行	4,600	3,820.00	17,572,000
宮崎銀行	5,200	3,285.00	17,082,000
佐賀銀行	4,700	2,065.00	9,705,500
十八銀行	4,600	2,853.00	13,123,800
沖縄銀行	6,600	3,735.00	24,651,000
琉球銀行	17,000	1,298.00	22,066,000
セブン銀行	237,500	352.00	83,600,000
みずほフィナンシャルグループ	9,556,000	188.30	1,799,394,800
山口フィナンシャルグループ	86,600	1,176.00	101,841,600

名古屋銀行	6,000	3,670.00	22,020,000
北洋銀行	107,200	329.00	35,268,800
愛知銀行	2,800	4,390.00	12,292,000
中京銀行	3,700	2,355.00	8,713,500
大光銀行	3,500	2,125.00	7,437,500
愛媛銀行	11,000	1,155.00	12,705,000
京葉銀行	31,000	800.00	24,800,000
栃木銀行	39,200	295.00	11,564,000
北日本銀行	3,000	2,484.00	7,452,000
東和銀行	13,800	934.00	12,889,200
福島銀行	10,000	564.00	5,640,000
トモニホールディングス	57,000	473.00	26,961,000
フィデアホールディングス	83,000	155.00	12,865,000
池田泉州ホールディングス	77,800	338.00	26,296,400
F P G	23,200	1,230.00	28,536,000
S B Iホールディングス	83,800	2,576.00	215,868,800
ジャフコ	11,700	4,150.00	48,555,000
大和証券グループ本社	563,500	626.50	353,032,750
野村ホールディングス	1,291,000	511.40	660,217,400
岡三証券グループ	61,400	558.00	34,261,200
丸三証券	23,000	894.00	20,562,000
東洋証券	32,000	205.00	6,560,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	84,300	555.00	46,786,500
水戸証券	24,000	307.00	7,368,000
いちよし証券	16,000	957.00	15,312,000
松井証券	34,500	1,286.00	44,367,000
マネックスグループ	66,500	420.00	27,930,000
カブドットコム証券	55,200	419.00	23,128,800
極東証券	10,000	1,312.00	13,120,000
岩井コスモホールディングス	8,000	1,411.00	11,288,000
藍澤證券	15,400	765.00	11,781,000
かんぽ生命保険	26,600	2,865.00	76,209,000
S O M P Oホールディングス	137,900	4,386.00	604,829,400
アニコム ホールディングス	5,900	3,765.00	22,213,500
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	183,800	3,445.00	633,191,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	57,700	2,380.00	137,326,000
第一生命ホールディングス	398,000	1,978.00	787,244,000
東京海上ホールディングス	255,000	5,605.00	1,429,275,000
T & Dホールディングス	216,900	1,613.00	349,859,700
アドバンスクリエイト	4,000	2,057.00	8,228,000
全国保証	20,200	3,880.00	78,376,000
アルヒ	7,000	1,797.00	12,579,000

クレディセゾン	49,400	1,457.00	71,975,800
芙蓉総合リース	8,100	6,880.00	55,728,000
興銀リース	13,700	2,800.00	38,360,000
東京センチュリー	14,100	5,420.00	76,422,000
日本証券金融	34,200	660.00	22,572,000
アイフル	113,300	311.00	35,236,300
リコーリース	5,800	3,695.00	21,431,000
イオンフィナンシャルサービス	44,700	2,200.00	98,340,000
アコム	142,300	417.00	59,339,100
ジャックス	8,700	2,058.00	17,904,600
オリエントコーポレーション	194,000	176.00	34,144,000
日立キャピタル	16,700	2,805.00	46,843,500
オリックス	469,500	1,839.50	863,645,250
三菱UFJリース	158,200	619.00	97,925,800
日本取引所グループ	190,200	2,045.00	388,959,000
イー・ギャランティ	8,000	1,120.00	8,960,000
NECキャピタルソリューション	3,300	1,686.00	5,563,800
いちご	90,300	389.00	35,126,700
日本駐車場開発	90,400	160.00	14,464,000
ヒューリック	147,000	1,038.00	152,586,000
三栄建築設計	3,600	1,575.00	5,670,000
スター・マイカ	4,000	1,785.00	7,140,000
野村不動産ホールディングス	46,800	2,242.00	104,925,600
三重交通グループホールディングス	16,400	614.00	10,069,600
サムティ	10,200	1,516.00	15,463,200
ディア・ライフ	10,100	526.00	5,312,600
日本商業開発	5,100	1,732.00	8,833,200
プレサンスコーポレーション	11,400	1,416.00	16,142,400
ユニゾホールディングス	11,000	2,312.00	25,432,000
日本管理センター	5,800	1,019.00	5,910,200
フージャースホールディングス	17,400	656.00	11,414,400
オープンハウス	11,500	4,040.00	46,460,000
東急不動産ホールディングス	189,100	637.00	120,456,700
飯田グループホールディングス	58,700	2,003.00	117,576,100
ムゲンエステート	6,500	691.00	4,491,500
ハウスドゥ	2,900	1,248.00	3,619,200
パーク24	41,300	3,065.00	126,584,500
バラカ	2,800	1,936.00	5,420,800
三井不動産	373,500	2,715.00	1,014,052,500
三菱地所	493,400	1,821.00	898,481,400
平和不動産	13,500	1,941.00	26,203,500
東京建物	77,500	1,294.00	100,285,000

ダイビル	20,700	1,242.00	25,709,400
京阪神ビルディング	15,000	912.00	13,680,000
住友不動産	158,400	4,208.00	666,547,200
大京	10,800	2,969.00	32,065,200
テオオーシー	16,700	851.00	14,211,700
東京楽天地	1,800	4,845.00	8,721,000
レオパレス21	91,400	493.00	45,060,200
スターツコーポレーション	9,300	2,654.00	24,682,200
フジ住宅	11,800	907.00	10,702,600
空港施設	13,300	599.00	7,966,700
ゴールドクレスト	6,200	1,764.00	10,936,800
日本エスリード	4,200	1,621.00	6,808,200
日神不動産	13,500	513.00	6,925,500
日本エスコン	14,100	737.00	10,391,700
タカラレーベン	35,800	343.00	12,279,400
サンヨーハウジング名古屋	7,000	1,044.00	7,308,000
イオンモール	35,400	2,041.00	72,251,400
カチタス	8,000	3,265.00	26,120,000
トーセイ	10,800	1,029.00	11,113,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	44,000	1,679.00	73,876,000
サンフロンティア不動産	10,500	1,202.00	12,621,000
エフ・ジェー・ネクスト	8,200	944.00	7,740,800
日本空港ビルデング	22,600	4,410.00	99,666,000
日本工営	5,000	2,731.00	13,655,000
LIFULL	24,400	897.00	21,886,800
ジェイエイシーリクルートメント	5,900	2,315.00	13,658,500
日本M&Aセンター	51,300	2,647.00	135,791,100
タケエイ	9,900	866.00	8,573,400
トラスト・テック	3,400	3,260.00	11,084,000
コシダカホールディングス	18,500	1,535.00	28,397,500
パソナグループ	7,000	1,397.00	9,779,000
リンクアンドモチベーション	12,900	1,041.00	13,428,900
GCA	8,500	802.00	6,817,000
エス・エム・エス	25,300	1,870.00	47,311,000
パーソルホールディングス	68,300	2,126.00	145,205,800
リニカル	4,400	1,616.00	7,110,400
クックパッド	23,900	413.00	9,870,700
学情	3,600	1,536.00	5,529,600
スタジオアリス	3,800	2,598.00	9,872,400
シミックホールディングス	4,400	2,177.00	9,578,800
総合警備保障	27,100	5,340.00	144,714,000
カカコム	51,900	2,284.00	118,539,600

アイロムグループ	3,100	2,193.00	6,798,300
ルネサンス	4,300	2,372.00	10,199,600
ディップ	10,900	2,550.00	27,795,000
オプトホールディング	4,500	2,117.00	9,526,500
新日本科学	11,600	711.00	8,247,600
ツクイ	16,600	1,021.00	16,948,600
エムスリー	143,900	1,834.00	263,912,600
アウトソーシング	36,000	1,423.00	51,228,000
ウェルネット	8,400	1,145.00	9,618,000
ワールドホールディングス	2,200	2,736.00	6,019,200
ディー・エヌ・エー	37,100	2,106.00	78,132,600
博報堂D Yホールディングス	94,300	1,738.00	163,893,400
ぐるなび	10,700	842.00	9,009,400
エスアールジータカミヤ	9,400	695.00	6,533,000
ジャパンベストレスキューシステム	6,300	1,624.00	10,231,200
ファンコミュニケーションズ	20,200	705.00	14,241,000
ライク	3,300	1,662.00	5,484,600
WDBホールディングス	3,400	2,878.00	9,785,200
バリューコマース	5,000	1,486.00	7,430,000
インフォマート	38,000	1,394.00	52,972,000
J Pホールディングス	25,400	309.00	7,848,600
E P Sホールディングス	10,400	2,185.00	22,724,000
プレステージ・インターナショナル	13,400	1,441.00	19,309,400
アミューズ	4,300	2,737.00	11,769,100
ドリームインキュベータ	2,900	1,895.00	5,495,500
クイック	4,700	1,517.00	7,129,900
ケネディクス	64,900	535.00	34,721,500
電通	83,000	5,060.00	419,980,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,000	1,929.00	5,787,000
ぴあ	2,100	5,110.00	10,731,000
イオンファンタジー	2,300	3,170.00	7,291,000
シーティーエス	9,200	757.00	6,964,400
ネクシィーズグループ	2,400	1,803.00	4,327,200
みらかホールディングス	19,500	2,625.00	51,187,500
アルプス技研	6,100	2,098.00	12,797,800
日本空調サービス	9,600	761.00	7,305,600
オリエンタルランド	80,600	11,295.00	910,377,000
ダスキン	18,600	2,617.00	48,676,200
明光ネットワークジャパン	10,200	1,039.00	10,597,800
ファルコホールディングス	5,200	1,666.00	8,663,200
ラウンドワン	21,400	1,260.00	26,964,000
リゾートトラスト	29,500	1,867.00	55,076,500

ビー・エム・エル	8,800	2,885.00	25,388,000
りらいあコミュニケーションズ	12,100	1,061.00	12,838,100
リソー教育	36,300	390.00	14,157,000
ユー・エス・エス	83,400	2,014.00	167,967,600
サイバーエージェント	42,200	5,140.00	216,908,000
楽天	319,700	914.00	292,205,800
クリーク・アンド・リバー社	4,900	1,186.00	5,811,400
テー・オー・ダブリュー	8,300	896.00	7,436,800
セントラルスポーツ	2,900	3,790.00	10,991,000
フルキャストホールディングス	6,800	2,311.00	15,714,800
エン・ジャパン	7,600	4,580.00	34,808,000
テクノプロ・ホールディングス	13,000	5,680.00	73,840,000
Gunosy	4,400	3,380.00	14,872,000
イー・ガーディアン	3,600	2,675.00	9,630,000
ジャパンマテリアル	18,900	1,314.00	24,834,600
ベクトル	8,600	1,840.00	15,824,000
アサンテ	3,500	2,278.00	7,973,000
N・フィールド	5,000	1,154.00	5,770,000
バリューHR	2,200	2,074.00	4,562,800
M&Aキャピタルパートナーズ	1,800	4,265.00	7,677,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,700	1,572.00	5,816,400
アビスト	1,400	3,530.00	4,942,000
シグマクシス	4,400	1,076.00	4,734,400
ウィルグループ	5,400	1,181.00	6,377,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,500	465.00	5,347,500
リクルートホールディングス	488,700	3,123.00	1,526,210,100
エラン	2,600	3,000.00	7,800,000
日本郵政	556,700	1,382.00	769,359,400
ベルシステム24ホールディングス	11,600	1,507.00	17,481,200
鎌倉新書	5,400	1,254.00	6,771,600
LITALICO	2,000	1,910.00	3,820,000
エボラブルアジア	2,400	2,259.00	5,421,600
ストライク	1,900	2,929.00	5,565,100
ソラスト	17,000	1,436.00	24,412,000
インソース	2,500	2,471.00	6,177,500
キャリアインデックス	2,800	2,117.00	5,927,600
MS - Japan	3,200	1,562.00	4,998,400
グレイステクノロジー	2,000	2,151.00	4,302,000
ジャパンエレベーターサービスホールディング	4,500	2,125.00	9,562,500
日総工産	2,000	1,965.00	3,930,000
キュービーネットホールディングス	4,000	2,219.00	8,876,000
スプリックス	2,200	1,947.00	4,283,400

リログループ	37,400	3,120.00	116,688,000	
東祥	4,300	4,230.00	18,189,000	
エイチ・アイ・エス	12,000	3,825.00	45,900,000	
共立メンテナンス	10,400	5,700.00	59,280,000	
イチネンホールディングス	8,500	1,456.00	12,376,000	
建設技術研究所	5,700	1,468.00	8,367,600	
スペース	5,300	1,243.00	6,587,900	
燦ホールディングス	2,300	2,576.00	5,924,800	
東京テアトル	4,900	1,350.00	6,615,000	
ナガワ	2,000	6,350.00	12,700,000	
よみうりランド	2,300	4,225.00	9,717,500	
東京都競馬	4,600	3,405.00	15,663,000	
常磐興産	5,300	1,757.00	9,312,100	
カナモト	9,700	3,340.00	32,398,000	
東京ドーム	25,800	1,039.00	26,806,200	
西尾レントオール	7,000	4,145.00	29,015,000	
トランス・コスモス	7,500	2,624.00	19,680,000	
乃村工藝社	15,900	3,045.00	48,415,500	
藤田観光	3,300	3,170.00	10,461,000	
KNT - CTホールディングス	4,300	1,288.00	5,538,400	
日本管財	7,000	2,089.00	14,623,000	
トーカイ	6,600	2,793.00	18,433,800	
セコム	72,400	9,606.00	695,474,400	
セントラル警備保障	3,400	6,340.00	21,556,000	
丹青社	13,200	1,290.00	17,028,000	
メイテック	8,900	5,120.00	45,568,000	
応用地質	8,300	1,338.00	11,105,400	
船井総研ホールディングス	14,100	2,095.00	29,539,500	
オオバ	7,800	732.00	5,709,600	
学究社	4,200	1,649.00	6,925,800	
ベネッセホールディングス	25,100	3,370.00	84,587,000	
イオンディライト	8,200	3,995.00	32,759,000	
ナック	6,000	1,097.00	6,582,000	
ニチイ学館	10,500	1,145.00	12,022,500	
ダイセキ	11,400	2,628.00	29,959,200	
合計	81,162,800		168,579,248,010	

## (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8期中間計算期間(平成30年12月1日から令和 1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8期中間計算期間 (令和1年5月31日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	54,221,625
親投資信託受益証券	22,620,653,614
流動資産合計	22,674,875,239
資産合計	22,674,875,239
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	54,171,450
未払受託者報酬	13,562
未払委託者報酬	94,935
未払利息	158
その他未払費用	4,585
流動負債合計	54,284,690
負債合計	54,284,690
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	9,703,603,171
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金( )	12,916,987,378
元本等合計	22,620,590,549
純資産合計	22,620,590,549
負債純資産合計	22,674,875,239

## （ 2 ） 【 中間損益及び剰余金計算書 】

（ 単位：円 ）

第8期中間計算期間	
自 平成30年12月 1日	
至 令和 1年 5月31日	
営業収益	
有価証券売買等損益	1,724,952,726
営業収益合計	1,724,952,726
営業費用	
支払利息	10,672
受託者報酬	2,264,305
委託者報酬	15,850,080
その他費用	575,267
営業費用合計	18,700,324
営業利益又は営業損失（ ）	1,743,653,050
経常利益又は経常損失（ ）	1,743,653,050
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,743,653,050
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（ ）	72,978,862
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,777,079,721
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,922,856,106
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	3,922,856,106
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,112,274,261
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,112,274,261
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（ ）	12,916,987,378

## (3) 【中間注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第8期中間計算期間
	自 平成30年12月 1日 至 令和 1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8期中間計算期間	
	(令和 1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		9,703,603,171口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.3312円
	(10,000口当たりの純資産額)	23,312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8期中間計算期間 (令和1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ん。
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8期中間計算期間 (令和1年5月31日現在)
期首元本額	7,655,600,244円
期中追加設定元本額	2,781,424,696円
期中一部解約元本額	733,421,769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)

(令和1年5月31日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,111,478,412
株式	159,552,776,910
未収配当金	1,755,126,624
前払金	150,860,000
流動資産合計	163,570,241,946

(令和 1年 5月31日現在)

資産合計	163,570,241,946
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	151,122,440
未払金	60,118,640
未払解約金	155,455,916
未払利息	6,189
その他未払費用	66,465
流動負債合計	366,769,650
負債合計	366,769,650
純資産の部	
元本等	
元本	68,440,897,648
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	94,762,574,648
元本等合計	163,203,472,296
純資産合計	163,203,472,296
負債純資産合計	163,570,241,946

## 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成30年12月 1日 至 令和 1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) 金融商品取引所等の上場されている有価証券 金融商品取引所等の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) 金融商品取引所等の上場されていない有価証券 金融商品取引所等の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	(令和1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	2,553,600,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		68,440,897,648口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.3846円
	(10,000口当たりの純資産額)	23,846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	(令和1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)

(令和1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	3,810,702,440	-	3,659,580,000	151,122,440
	東証株価指数先物	3,810,702,440	-	3,659,580,000	151,122,440
合計		3,810,702,440	-	3,659,580,000	151,122,440

## (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)

(令和 1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	66,912,228,971円
同期中における追加設定元本額	7,869,514,140円
同期中における一部解約元本額	6,340,845,463円
令和 1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	10,269,228,264円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	877,119,285円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,109,585,500円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,939,007,660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)	100,833,995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)	7,178,506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)	24,861,471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)	64,019,654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)	106,875,206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)	66,858,929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)	151,076,109円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,856,947,659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	9,486,141,749円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	1,043,818,306円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	971,325,415円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	925,403,810円
イオン・バランス戦略ファンド	37,037,566円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	10,547,808円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	23,751,326円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	25,639,492円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	86,115,498円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	51,213,587円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	81,826,671円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	9,292,391円
S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	4,563,962,410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>	25,823,624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>	225,151,325円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用>	3,456,981,691円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用>	2,526,957,643円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 <適格機関投資家専用>	9,223,383,744円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定>	60,826,883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>	226,776,172円

世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	761,723円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	949,893,389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>	58,426,213円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	390,355,502円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,117,775,166円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	970,249,878円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,133,797,202円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,614,813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)	820,437,364円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	64,850,126円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	25,353,053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)	876,036,458円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	109,020,127円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	48,923,196円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	23,097,649円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	213,120,040円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	396,395,318円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	162,209,912円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	119,755,379円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	63,077,521円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,591,895円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	78,132,755円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	944,060,807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)	202,514,822円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	20,958,549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>	1,559,466,909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>	221,063,787円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,575,906,619円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	133,073,322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>	11,578,123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>	132,632,338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>	63,471,476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>	137,325,574円
SMAM・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>	170,401,294円
合計	68,440,897,648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

2019年 6月28日現在

資産総額	24,275,133,989円
負債総額	32,086,496円
純資産総額（ - ）	24,243,047,493円
発行済口数	10,125,349,254口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3943円
（1万口当たり純資産額）	（23,943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

	2019年6月28日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060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8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。

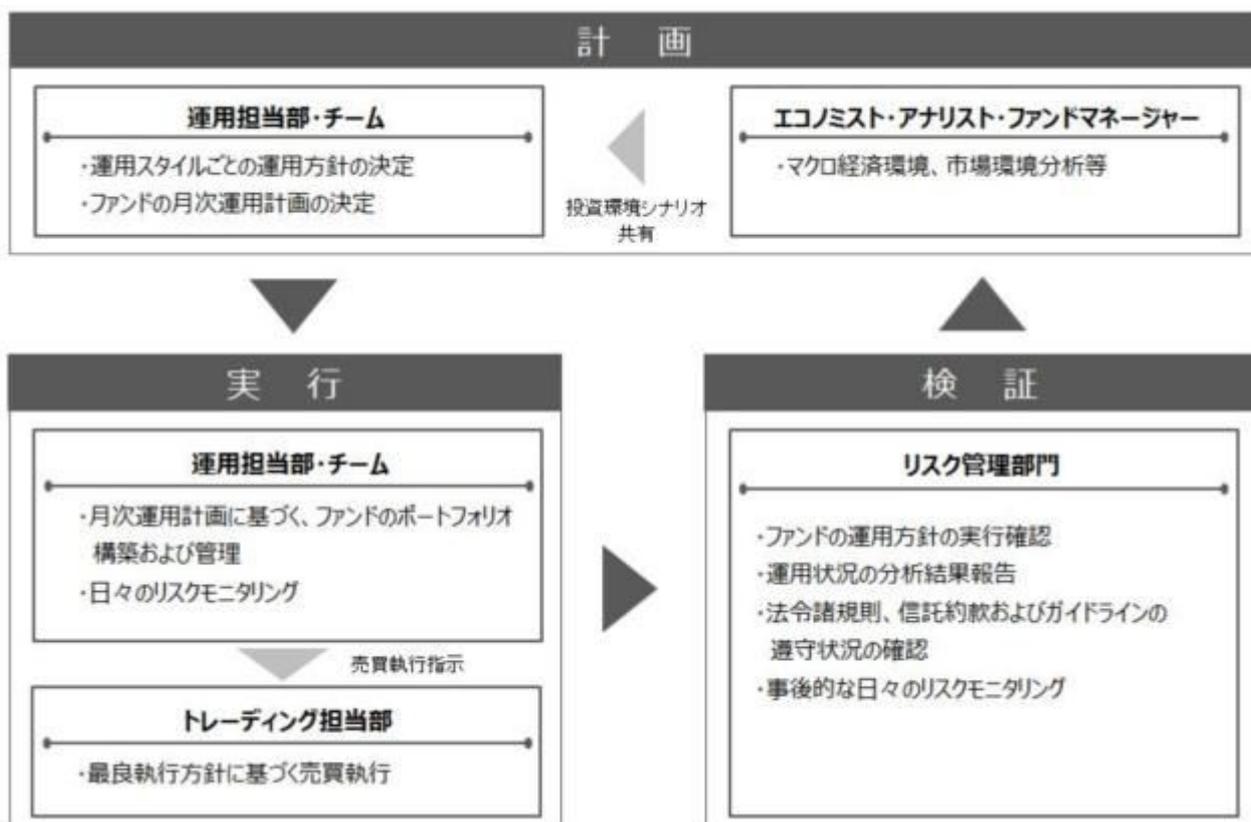
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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、必要に応じて取締役会長1名を選定することができます。

##### 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。

2019年6月28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。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	773	8,410,967
単位型株式投資信託	116	590,384
追加型公社債投資信託	1	28,707
単位型公社債投資信託	189	534,141
合計	1,079	9,564,201

## 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30年4月1日から平成31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30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	20,873,870	13,755,961
顧客分別金信託	20,010	20,011
前払費用	402,249	476,456
未収入金	39,030	64,856
未収委託者報酬	6,332,203	6,963,077
未収運用受託報酬	1,725,215	1,129,548
未収投資助言報酬	316,407	285,668
未収収益	50,321	44,150
その他の流動資産	10,891	31,771
流動資産合計	29,770,200	22,771,504
固定資産		

有形固定資産	1		
建物		185,371	173,517
器具備品		300,694	751,471
有形固定資産合計		486,065	924,988
無形固定資産			
ソフトウェア		409,765	479,867
ソフトウェア仮勘定		5,755	183,528
電話加入権		56	44
商標権		-	60
無形固定資産合計		415,576	663,501
投資その他の資産			
投資有価証券		10,616,594	10,829,628
関係会社株式		10,412,523	10,252,067
長期差入保証金		658,505	2,004,451
長期前払費用		69,423	97,107
会員権		7,819	7,819
繰延税金資産		1,394,447	1,426,381
投資その他の資産合計		23,159,314	24,617,457
固定資産合計		24,060,956	26,205,946
資産合計		53,831,157	48,977,450

(単位：千円)

	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
顧客からの預り金	84	4,534
その他の預り金	92,326	1,480,229
<b>未払金</b>		
未払収益分配金	649	1,122
未払償還金	137,522	137,522
未払手数料	2,783,763	3,246,133
その他未払金	236,739	768,373
未払費用	3,433,641	3,535,589
未払消費税等	547,706	84,966
未払法人税等	1,785,341	670,761
賞与引当金	1,507,256	1,302,052
その他の流動負債	1,408	18,110
流動負債合計	10,526,438	11,249,395
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	3,319,830	3,418,601
賞与引当金	99,721	5,074
その他の固定負債	3,363	5,074
固定負債合計	3,422,915	3,428,751
負債合計	13,949,354	14,678,146
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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	26,561,078	21,255,054
利益剰余金合計	28,382,283	23,076,258
株主資本計	39,011,267	33,705,242
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	870,535	594,061
評価・換算差額等合計	870,535	594,061
純資産合計	39,881,802	34,299,304
負債・純資産合計	53,831,157	48,977,450

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	平成29年4月1日	(自	平成30年4月1日
	至	平成30年3月31日)	至	平成31年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		36,538,981		39,156,499
運用受託報酬		8,362,118		6,277,217
投資助言報酬		1,440,233		1,332,888
その他営業収益				
情報提供コンサルタント				
業務報酬		5,000		-
サービス支援手数料		128,324		182,502
その他		55,820		49,507
営業収益計		46,530,479		46,998,614
営業費用				
支払手数料		16,961,384		18,499,433
広告宣伝費		353,971		361,696
公告費		1,140		125
調査費				
調査費		1,654,233		1,752,905
委託調査費		5,972,473		6,050,441
営業雑経費				
通信費		40,066		46,551
印刷費		339,048		338,465
協会費		-		24,700
諸会費		45,465		23,756
情報機器関連費		2,582,734		2,872,416
販売促進費		34,333		49,118
その他		136,669		148,307
営業費用合計		28,121,520		30,167,918
一般管理費				

給料		
役員報酬	196,529	190,951
給料・手当	6,190,716	6,308,066
賞与	601,375	514,259
賞与引当金繰入額	1,566,810	1,235,936
交際費	25,709	27,802
寄付金	-	82
事務委託費	256,413	286,905
旅費交通費	220,569	228,538
租税公課	282,036	285,369
不動産賃借料	654,286	612,410
退職給付費用	419,884	463,553
固定資産減価償却費	329,756	378,530
諸経費	285,490	290,243
一般管理費合計	11,029,580	10,822,651
営業利益	7,379,378	6,008,044

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	当事業年度 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	51,335	-
受取利息	520	623
時効成立分配金・償還金	2,622	72
原稿・講演料	894	1,951
雑収入	10,669	36,408
営業外収益合計	66,042	39,055
営業外費用		
為替差損	5,125	15,760
雑損失	913	7,027
営業外費用合計	6,038	22,787
経常利益	7,439,383	6,024,312
特別利益		
投資有価証券償還益	61,842	289,451
投資有価証券売却益	30,980	7,247
過去勤務費用償却益	1	79,850
特別利益合計	92,822	376,549
特別損失		
固定資産除却損	2	1,462
投資有価証券償還損		13,668
投資有価証券売却損		14,605
関係会社株式評価損	3	160,455
合併関連費用	4	187,140
特別損失合計	505,996	377,331
税引前当期純利益	7,026,209	6,023,530
法人税、住民税及び事業税	2,350,891	1,750,031
法人税等調整額	280,166	90,084
法人税等合計	2,070,725	1,840,116
当期純利益	4,955,483	4,183,413

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（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						
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					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
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)							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	25,314,279	35,943,263	327,116	327,116	36,270,379
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)			543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	3,068,003	3,068,003	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802

当事業年度（自 平成30年 4 月 1 日 至 平成31年 3 月31日）

（単位：千円）

	株主資本						
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					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	26,561,078
当期変動額							
剰余金の配当							9,489,438
当期純利益							4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)							
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	5,306,024
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054

	株主資本	評価・換算差額等
--	------	----------

	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
	利益剰余金 合計				
当期首残高	28,382,283	39,011,267	870,535	870,535	39,881,802
当期変動額					
剰余金の配当	9,489,438	9,489,438			9,489,438
当期純利益	4,183,413	4,183,413			4,183,413
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)			276,474	276,474	276,474
当期変動額合計	5,306,024	5,306,024	276,474	276,474	5,582,498
当期末残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304

## [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) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (2) 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。

## (表示方法の変更)

「税効果会計に係る会計基準」の一部改正(企業会計基準第28号平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用し、

繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更するとともに、税効果会計関係注記を変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」715,988千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,394,447千円に含めて表示しております。

また、税効果会計関係注記において、税効果会計基準一部改正第3項から第4項に定める「税効果会計に係る会計基準」注解(注8)(評価性引当額の合計額を除く。)に記載された内容を追加しております。ただし、当該内容のうち前事業年度に係る内容については、税効果会計基準一部改正第7項に定める経過的な取扱いに従って記載しておりません。

#### (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30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
建物	312,784千円	350,176千円
器具備品	768,929千円	922,553千円

##### 2 当座借越契約

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30年3月31日)	当事業年度 (平成31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、令和5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30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	204,923千円	174,854千円

#### (損益計算書関係)

##### 1 過去勤務費用償却益

過去勤務費用償却益は、退職金規程を変更したことに伴い発生した過去勤務費用の一時処理額であります。

##### 2 固定資産除却損

	前事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	当事業年度 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
器具備品	0 千円	695 千円
ソフトウェア	9,000 千円	766 千円
ソフトウェア仮勘定	345,695 千円	- 千円

##### 3 関係会社株式評価損

関係会社株式評価損は、関連会社の株式について減損処理を適用したことによるものであります。

##### 4 合併関連費用

合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び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業務委託費用であります。

#### (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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	107,000.00	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	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

当社は平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

	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	17,622,360株	-	17,640,000株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

当社は平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。

当該株式分割は平成30年11月1日を効力発生日としておりますので、平成31年1月31日を基準日とする一株当たり配当額につきましては、株式分割後の株式数を基準に記載しております。

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30年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000.00	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日
平成31年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	平成31年 1月31日	平成31年 3月22日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの  
令和1年6月24日開催の臨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
令和1年6月24日 臨時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,469,600	140.00	平成31年 3月28日	令和1年 6月25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30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
1年以内	208,187	597,239
1年超	42,916	6,115,662
合計	251,104	6,712,901

## (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おります。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おります。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っておりません。

## (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30年3月31日）

（単位：千円）

区分	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	-

当事業年度（平成31年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	13,755,961	13,755,961	-
(2)顧客分別金信託	20,011	20,011	-
(3)未収委託者報酬	6,963,077	6,963,077	-
(4)未収運用受託報酬	1,129,548	1,129,548	-
(5)未収投資助言報酬	285,668	285,668	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,829,330	10,829,330	-
(7)長期差入保証金	2,004,451	2,004,451	-
資産計	34,988,051	34,988,051	-

(1)顧客からの預り金	4,534	4,534	-
(2)未払手数料	3,246,133	3,246,133	-
負債計	3,250,667	3,250,667	-

(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)顧客からの預り金及び(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)

区分	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
其他有価証券 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	10,252,067
合計	10,412,523	10,252,067

其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)其他有価証券」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	-	-

当事業年度（平成31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	13,755,961	-	-	-
顧客分別金信託	20,011	-	-	-
未収委託者報酬	6,963,077	-	-	-
未収運用受託報酬	1,129,548	-	-	-
未収投資助言報酬	285,668	-	-	-
長期差入保証金	54,900	1,949,551	-	-
合計	22,209,168	1,949,551	-	-

(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。

当事業年度（平成31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10,252,067千円）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。

当事業年度（平成31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	7,545,410	6,613,088	932,322
小計	7,545,410	6,613,088	932,322
(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	3,283,920	3,360,000	76,080
小計	3,283,920	3,360,000	76,080
合計	10,829,330	9,973,088	856,242

（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

当事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成31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
728,127	7,247	14,605

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

当事業年度において、有価証券について160,455千円（関係会社株式160,455千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては子会社株式及び関連会社株式については、当該株式の発行会社の財務状況等を勘案した上で、回復可能性を検討し、回復可能性のないものについて減損処理を行っております。

（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29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	当事業年度 (自 平成30年 4月 1日 至 平成31年 3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,177,131	3,319,830
勤務費用	285,715	267,362
利息費用	2,922	-
数理計算上の差異の発生額	51,212	3,658
退職給付の支払額	94,727	85,082
過去勤務費用の発生額	-	79,850
退職給付債務の期末残高	3,319,830	3,418,601

## (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30年 3月31日)	当事業年度 (平成31年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,319,830	3,418,601
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	3,319,830	3,418,601

## (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29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	当事業年度 (自 平成30年 4月 1日 至 平成31年 3月31日)
勤務費用	285,715	267,362
利息費用	2,922	-
数理計算上の差異の費用処理額	51,212	3,658
過去勤務費用償却益	-	79,850
その他	182,458	199,849
確定給付制度に係る退職給付費用	419,884	383,703

(注) 1.退職金規程を変更したことに伴い、過去勤務費用償却益79,850千円を特別利益に計上しております。

2.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であります。

## (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29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)	当事業年度 (自 平成30年 4月 1日 至 平成31年 3月31日)
割引率	0.000%	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147,195千円、当事業年度156,457千円であります。

## (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30年 3月31日)	当事業年度 (平成31年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,016,532	1,046,775
賞与引当金	492,056	400,242
調査費	90,509	80,983
未払金	60,851	57,192
未払事業税	102,103	54,797
ソフトウェア償却	11,289	17,501
その他	7,903	82,798

		有価証券届出書（内国投資信託受益証券）
繰延税金資産小計	1,781,245	1,740,292
評価性引当額（注）	2,597	51,729
繰延税金資産合計	1,778,648	1,688,563
繰延税金負債		
其他有価証券評価差額金	384,200	262,181
繰延税金負債合計	384,200	262,181
繰延税金資産の純額	1,394,447	1,426,381

（注）評価性引当額が49,131千円増加しております。この増加の内容は、主として関係会社株式評価損に係る評価性引当額を追加的に認識したことに伴うものであります。

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30年3月31日）	当事業年度 （平成31年3月31日）
法定実効税率	30.8%	30.6%
（調整）		
評価性引当額の増減	-	0.8
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.9
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	1.9	1.4
その他	0.1	0.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.4	30.5

（セグメント情報等）

前事業年度（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。

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31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	39,156,499	6,277,217	1,332,888	232,009	46,998,614

(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	(株)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(株)	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）

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31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	2,499,836	未払 手数料	399,447
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	5,789,062	未払 手数料	1,154,875

(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29年4月1日 至 平成30年3月31日)	当事業年度 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	2,260.87円	1,944.40円
1株当たり当期純利益金額	280.92円	237.15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. 当社は、平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。これに伴い、前事業年度の期首に当該株式分割が行われたと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり当期純利益を算定しております。

3. 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29年4月1日 至 平成30年3月31日)	当事業年度 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,955,483	4,183,413
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)	4,955,483	4,183,413
期中平均株式数(株)	17,640,000	17,640,000

(重要な後発事象)

前事業年度(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。

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

取得による企業結合

当社は、平成30年9月28日開催の当社取締役会において、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結しました。本合併契約に基づき、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併いたしました。

1. 企業結合の概要

(1) 被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称 大和住銀投信投資顧問株式会社  
事業の内容 投資運用業、投資助言・代理業等

(2)企業結合を行う主な理由

資産運用ビジネスはグローバルに成長拡大しており、お客さまから求められる運用力やサービスはますます高度化しております。本件合併は、このようなお客さまからのニーズに対応するために、両運用会社の持つ強み・ノウハウを結集した、フィデューシャリー・デューティーに基づく最高品質の運用パフォーマンスとサービスを提供する資産運用会社の実現を図るものであります。

(3)企業結合日

平成31年4月1日

(4)企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀投信投資顧問株式会社を消滅会社とする吸収合併方式であります。

(5)結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

(6)取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

2. 合併比率及びその算定方法並びに交付した株式数

(1)合併比率

大和住銀投信投資顧問株式会社の普通株式1株に対し、当社の普通株式4,2156株を割当て交付いたしました。

(2)合併比率の算定方法

当社はEYトランザクション・アドバイザー・サービス株式会社を、大和住銀投信投資顧問株式会社はPwCアドバイザー合同会社を、合併比率の算定に関する第三者算定機関としてそれぞれ選定し、各第三者算定機関による算定結果を参考に、両社の財務の状況、資産の状況、将来の見通し等の要因を総合的に勘案し、合併比率について慎重に協議を重ねた結果、合併比率が妥当であると判断し、合意に至ったものであります。

(3)交付した株式数

普通株式：16,230,060株

3. 主要な取得関連費用の内容及び金額

デューデリジェンス費用13,700千円

4. 取得原価の配分に関する事項

現時点では確定しておりません。

(参考)大和住銀投信投資顧問株式会社の経理状況

当該(参考)において、大和住銀投信投資顧問株式会社を「委託会社」または「当社」といいます。

1. 委託会社の財務諸表は、「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。)並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号。)により作成しております。

2. 財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第47期事業年度(平成30年4月1日から平成31年3月31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る監査を受けております。

## 独立監査人の監査報告書

令和1年6月14日

三井住友DS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 公認会計士 飯田 浩 司 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 栄 裕 印  
業務執行社員

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DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47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DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成31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、会社と三井住友アセットマネジメント株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。

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。

(注2) 四半データは監査の対象には含まれていません。

## (1) 貸借対照表

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	21,360,895	20,475,527

前払費用		204,460	230,059
未収入金		12,823	4,542
未収委託者報酬		3,363,312	2,923,589
未収運用受託報酬		1,198,432	870,546
未収収益		41,310	38,738
その他		7,553	3,324
流動資産計		26,188,788	24,546,329
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	75,557	225,975
器具備品	1	122,169	95,404
土地		710	710
リース資産	1	7,275	8,108
有形固定資産計		205,712	330,198
無形固定資産			
ソフトウェア		73,887	159,087
ソフトウェア仮勘定		-	6,115
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		86,593	177,909
投資その他の資産			
投資有価証券		10,257,600	11,025,039
関係会社株式		956,115	956,115
従業員長期貸付金		1,170	-
長期差入保証金		534,699	534,270
出資金		82,660	82,660
繰延税金資産		1,041,251	1,009,250
その他		-	8,397
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産計		12,852,746	13,594,982
固定資産計		13,145,052	14,103,090
資産合計		39,333,840	38,649,419

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	3,143	3,583
未払金	29,207	1,555,486
未払手数料	1,434,393	1,222,461
未払費用	1,287,722	1,203,269
未払法人税等	1,397,293	264,304
未払消費税等	135,042	48,437
賞与引当金	1,263,100	1,007,040
役員賞与引当金	85,600	72,900
その他	23,128	29,455
流動負債計	5,658,632	5,406,939
固定負債		
リース債務	4,698	5,173
退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
役員退職慰労引当金	88,050	-

長期未払金	-	204,333
資産除去債務	-	248,260
固定負債計	1,632,952	2,164,829
負債合計	7,291,585	7,571,769

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
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	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		
別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	28,387,042	27,516,774
利益剰余金合計	29,830,773	28,960,505
株主資本合計	31,987,042	31,116,774
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	55,213	39,124
評価・換算差額等合計	55,213	39,124
純資産合計	32,042,255	31,077,650
負債純資産合計	39,333,840	38,649,419

## (2) 損益計算書

(単位：千円)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
営業収益		
運用受託報酬	5,111,757	4,252,374
委託者報酬	26,383,145	24,415,734
その他営業収益	82,997	66,957
営業収益計	31,577,899	28,735,066
営業費用		
支払手数料	11,900,832	10,708,502
広告宣伝費	93,131	196,206
公告費	-	293
調査費		
調査費	1,637,364	2,076,042
委託調査費	2,959,680	3,032,753
委託計算費	79,120	77,597
営業雑経費		
通信費	42,497	38,715
印刷費	517,371	507,540
協会費	24,374	24,325
諸会費	3,778	1,994

その他		122,930	63,596
営業費用計		17,381,079	16,727,567
一般管理費			
給料			
役員報酬		218,127	217,030
給料・手当		2,809,008	3,002,836
賞与		86,028	48,878
退職金		9,864	2,855
福利厚生費		647,269	638,399
交際費		29,121	38,883
旅費交通費		159,224	153,694
租税公課		199,255	160,817
不動産賃借料		622,807	639,392
退職給付費用		219,724	324,082
固定資産減価償却費		71,624	141,154
賞与引当金繰入額		1,263,100	1,007,040
役員退職慰労引当金繰入額		36,130	102,860
役員賞与引当金繰入額		85,500	72,900
諸経費		901,001	1,011,941
一般管理費計		7,357,787	7,562,768
営業利益		6,839,032	4,444,730
営業外収益			
受取配当金		23,350	35,946
受取利息		199	178
投資有価証券売却益		6,350	45,345
その他		2,831	10,431
営業外収益計		32,732	91,902
営業外費用			
投資有価証券売却損		5,000	4,735
解約違約金		-	982
為替差損		1,784	828
その他		0	410
営業外費用計		6,784	6,956
経常利益		6,864,980	4,529,676
特別損失			
合併関連費用	2	-	179,376
固定資産除却損		-	4,121
特別損失計		-	183,498
税引前当期純利益		6,864,980	4,346,177
法人税、住民税及び事業税		2,242,775	1,339,010
法人税等調整額		78,014	73,635
法人税等合計		2,164,761	1,412,646
当期純利益		4,700,218	2,933,531

## (3) 株主資本等変動計算書

第46期（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					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		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	
					別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	26,100,773

当期変動額						
剰余金の配当						2,413,950
当期純利益						4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	2,286,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金 利益剰余金 合計	株主資本合計	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	27,544,504	29,700,773	37,917	37,917	29,738,691
当期変動額					
剰余金の配当	2,413,950	2,413,950			2,413,950
当期純利益	4,700,218	4,700,218			4,700,218
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			17,295	17,295	17,295
当期変動額合計	2,286,268	2,286,268	17,295	17,295	2,303,564
当期末残高	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		別途積立金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	28,387,042
当期変動額						
剰余金の配当						3,803,800
当期純利益						2,933,531
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	-	870,268
当期末残高	2,000,000	156,268	156,268	343,731	1,100,000	27,516,774

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金 利益剰余金 合計	株主資本合計	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	29,830,773	31,987,042	55,213	55,213	32,042,255
当期変動額					
剰余金の配当	3,803,800	3,803,800			3,803,800
当期純利益	2,933,531	2,933,531			2,933,531
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			94,337	94,337	94,337
当期変動額合計	870,268	870,268	94,337	94,337	964,605

当期末残高	28,960,505	31,116,774	39,124	39,124	31,077,650
-------	------------	------------	--------	--------	------------

## 注記事項

## (重要な会計方針)

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 総平均法による原価法を採用しております。</p> <p>(2) その他有価証券</p> <p>時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法(売却原価は総平均法により算出し、評価差額は全部純資産直入法により処理しております。)を採用しております。</p> <p>時価のないもの 総平均法による原価法を採用しております。</p>				
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>2～30年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(会計上の見積りの変更) 当事業年度において、当社と三井住友アセットマネジメント株式会社(以下「SMAM」)との間で合併契約を締結したことに伴い、将来利用不能となる固定資産について耐用年数を短縮し、将来にわたり変更しております。 これにより、従来の方法に比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益はそれぞれ15,534千円減少しております。</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、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。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>	建物	2～30年	器具備品	4～15年
建物	2～30年			
器具備品	4～15年			
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒による損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、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。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、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。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。 これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づき事業年度末における要支給額を計上しております。</p>				
<p>4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> <p>消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>				

## (表示方法の変更)

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」504,497千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,041,251千円に含めて表示しております。

（追加情報）

当社は、平成31年3月22日開催の臨時株主総会において、退任となる取締役及び監査役に対して、在任中の労に報いるため、当社所定の基準による相当額の範囲内で役員退職慰労金を支給することを決議しました。

これに伴い、当事業年度において役員退職慰労引当金184,610千円を長期未払金に振り替えております。

（貸借対照表関係）

第46期 (平成30年3月31日)		第47期 (平成31年3月31日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額		1.有形固定資産の減価償却累計額	
建物	465,964千円	建物	556,889千円
器具備品	266,621千円	器具備品	297,262千円
リース資産	8,719千円	リース資産	12,584千円

（損益計算書関係）

第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
-	2. 合併関連費用は、主に目論見書等の一斉改版費用及び当社とS M A Mとの合併に関する業務委託費用であります。

（株主資本等変動計算書関係）

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

（単位：千株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末
普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

2.配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成29年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,413,950	627	平成29年3月31日	平成29年6月24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となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成30年6月22日 定時株主総会	普通 株式	2,348,500	利益 剰余金	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1.発行済株式に関する事項

（単位：千株）

株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当事業年度末

普通株式	3,850	-	-	3,850
合計	3,850	-	-	3,850

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成30年6月22日 定時株主総会	普通株式	2,348,500	610	平成30年3月31日	平成30年6月23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となるもの

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成31年3月22日 臨時株主総会	普通株式	1,455,300	利益 剰余金	378	平成31年3月31日	令和1年6月25日

## (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・代理業などの資産運用事業を行っております。余裕資金は安全で流動性の高い金融資産で運用し、銀行からの借入や社債の発行はありません。

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

主たる営業債権は、投資運用業等より発生する未収委託者報酬、未収運用受託報酬であります。

これらの債権は、全て1年以内の債権であり、そのほとんどが信託財産の中から支払われるため、回収不能となるリスクは極めて軽微であります。

未収入金は、当社より他社へ出向している従業員給与等であり、1年以内の債権であります。

投資有価証券は、その大半が事業推進目的で設定した投資信託であり、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。

長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金であり、差入先の信用リスクに晒されております。

未払手数料は、投資信託の販売に係る支払手数料であります。また、未払費用は、投資信託の運用に係る再委託手数料、及び業務委託関連費用であります。

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行等に係るリスク)の管理

当社は、社内規定に従って取引先を選定し、担当部門で取引先の状況を定期的にモニタリングし、財務状況等の悪化等による回収懸念の早期把握や軽減を図っております。

市場リスク(為替や金利等の変動リスク)の管理

当社は、投資有価証券の一部を除いて、資金決済のほとんどを自国通貨で行っているため、為替の変動リスクは極めて限定的であります。

投資有価証券のうち自己設定投信については、その残高及び損益状況等を定期的に経営会議に報告しております。

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

資金調達に係る流動性リスク(支払期日に支払いを実行できなくなるリスク)の管理

当社は、適時に資金繰計画を作成・更新するとともに、社内規定に従って手元流動性を維持することにより、流動性リスクを管理しております。

## 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、次のとおりであります。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、次表に含めておりません(注2)を参照ください)。

第46期(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・預金	21,360,895	21,360,895	-
(2) 未収委託者報酬	3,363,312	3,363,312	-
(3) 未収運用受託報酬	1,198,432	1,198,432	-
(4) 未収入金	12,823	12,823	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	10,206,465	10,206,465	-
資産計	36,141,929	36,141,929	-
(1) 未払手数料	1,434,393	1,434,393	-
(2) 未払費用(*)	959,074	959,074	-
負債計	2,393,468	2,393,468	-

(\*) 金融商品に該当するものを表示しております。

第47期(平成31年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	20,475,527	20,475,527	-
(2) 未収委託者報酬	2,923,589	2,923,589	-
(3) 未収運用受託報酬	870,546	870,546	-
(4) 未収入金	4,542	4,542	-
(5) 投資有価証券 その他有価証券	10,979,968	10,979,968	-
(6) 長期差入保証金	524,592	524,592	-
資産計	35,778,767	35,778,767	-
(1) 未払手数料	1,222,461	1,222,461	-
(2) 未払費用(*)	807,875	807,875	-
負債計	2,030,337	2,030,337	-

(\*) 金融商品に該当するものを表示しております。

(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・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収入金

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おります。

(5) 投資有価証券

投資信託であり、公表されている基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項「有価証券関係」をご参照下さい。

(6) 長期差入保証金

敷金の性質及び賃貸借契約の期間から、時価は当該帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額によっております。

## 負債

(1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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おります。

(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

区分	第46期(平成30年3月31日)	第47期(平成31年3月31日)
(1) 其他有価証券 非上場株式	51,135	45,071
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115	956,115
(3) 長期差入保証金	534,699	9,677

これらについては、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時価開示の対象としておりません。このため、(1) 其他有価証券の非上場株式については2.(5) 投資有価証券には含めておりません。

## (注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期(平成30年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	21,360,895	-	-	-
未収委託者報酬	3,363,312	-	-	-
未収運用受託報酬	1,198,432	-	-	-
未収入金	12,823	-	-	-
投資有価証券				
其他有価証券の うち満期があるもの	1,923,400	373,466	657,576	-
合計	27,858,863	373,466	657,576	-

第47期(平成31年3月31日)

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金・預金	20,475,527	-	-	-
未収委託者報酬	2,923,589	-	-	-
未収運用受託報酬	870,546	-	-	-
未収入金	4,542	-	-	-
投資有価証券				
其他有価証券の うち満期があるもの	151,249	2,135,802	761,441	-
長期差入保証金	-	524,592	-	-
合計	24,425,455	2,660,395	761,441	-

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式

第46期(平成30年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円)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。

第47期(平成31年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円)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. 其他有価証券

第46期(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

貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	2,522,495	2,276,821	245,674
小計	2,522,495	2,276,821	245,674
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	7,683,969	7,850,063	166,093
小計	7,683,969	7,850,063	166,093
合計	10,206,465	10,126,884	79,580

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 51,135千円）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、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

第47期（平成31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
貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	2,207,351	1,967,041	240,309
小計	2,207,351	1,967,041	240,309
貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの その他 証券投資信託の受益証券	8,772,616	9,069,317	296,700
小計	8,772,616	9,069,317	296,700
合計	10,979,968	11,036,359	56,391

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 45,071千円）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、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	398,350	6,350	5,000

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

（単位：千円）

種類	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他	1,433,609	45,345	4,735

（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、退職金規程に基づく退職一時金制度のほか、確定拠出年金制度を採用しております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

#### 2. 簡便法を適用した確定給付制度

（1）簡便法を採用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

（単位：千円）

	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
退職給付引当金の期首残高	1,482,500	1,540,203
退職給付費用	147,235	248,717
退職給付の支払額	105,520	61,499
その他	15,987	20,359
退職給付引当金の期末残高	1,540,203	1,707,062

(注)前事業年度のその他は、転籍者の退職給付引当金受入れ額であります。

当事業年度のその他は、主に長期未払金への振り替えであります。

(2) 退職給付債務及び年金資産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)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
積立型制度の退職給付債務	-	-
年金資産	-	-
	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062
退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,540,203	1,707,062

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用 第46期 147,235千円 第47期 248,717千円

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第46期は72,489千円、第47期は75,365千円であります。

(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)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
繰延税金資産		
未払事業税	71,030	23,058
賞与引当金	386,761	308,355
社会保険料	30,549	27,751
未払事業所税	4,247	4,370
退職給付引当金	471,610	522,702
資産除去債務	-	77,318
投資有価証券	67,546	65,422
ゴルフ会員権	11,000	11,000
役員退職慰労引当金	26,961	-
その他有価証券評価差額金	-	17,266
その他	74,458	83,141
繰延税金資産小計	1,144,165	1,140,388
評価性引当額	78,546	76,422
繰延税金資産合計	1,065,618	1,063,965
繰延税金負債		
建物	-	54,715

その他有価証券評価差額金	24,367	-
繰延税金負債合計	24,367	54,715
繰延税金資産の純額	1,041,251	1,009,250

## 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差異の原因となった主な項目別の内訳

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
法定実効税率	-	30.62%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	0.80%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	0.09%
特定外国子会社等課税対象金額	-	1.99%
税額控除	-	0.64%
その他	-	0.36%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	32.50%

(注) 前事業年度は、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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

## (資産除去債務関係)

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

## (1) 当該資産除去債務の概要

主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等であります。

## (2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

当該契約に基づく退去予定期限までの期間を使用見込期間と見積り、資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから、割引前の見積り額を計上しております。

## (3) 当該資産除去債務の総額の増減

当事業年度において、主として本社の不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等について合理的な見積りが可能となったことから、「(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法」に記載の算定方法に則り、資産除去債務の金額を計算しております。資産除去債務の残高の推移は次のとおりであります。

(単位：千円)

	第46期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第47期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
期首残高	-	-
見積りの変更による増加額	-	248,260
期末残高	-	248,260

## (セグメント情報等)

セグメント情報

## 1. 報告セグメントの概要

当社は、「投資・金融サービス業」の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

関連情報

第46期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	26,383,145	5,111,757	82,997	31,577,899

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

## (2) 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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

## 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。

## 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。

## 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。

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

## 1. 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	投資信託委託業	投資一任業務	その他	合計
外部顧客からの営業収益	24,415,734	4,252,374	66,957	28,735,066

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

本邦の顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため記載を省略しております。

## (2) 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

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益10%以上を占める相手先がないため、記載は省略しております。

## 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。

## 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。

## 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。

## ( 関連当事者との取引 )

第46期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

## 兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金 (億円)	事業の 内容又は 職業	議決権 等の所有 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引 金額 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
----	--------	----	-------------	-------------------	-------------------	---------------	-------	------------------	----	------------------

その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	3,987,525	未払手数料	573,578
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,969,101	未払手数料	273,241

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

第47期(自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)

兄弟会社等

属性	会社等の名称	住所	資本金(億円)	事業の内容又は職業	議決権等の所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
その他の関係会社の子会社	大和証券株式会社	東京都千代田区	1,000	証券業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	4,328,153	未払手数料	540,879
その他の関係会社の子会社	株式会社三井住友銀行	東京都千代田区	17,709	銀行業	-	当社投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 1	1,465,685	未払手数料	228,197

取引条件及び取引条件の決定方針等

- 1 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性格等を勘案し総合的に決定しております。
- 2 上記金額の内、取引金額には消費税が含まれておらず、期末残高には消費税が含まれています。

(1株当たり情報)

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	8,322円66銭	8,072円12銭
1株当たり当期純利益金額	1,220円84銭	761円96銭

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

1株当たりの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。

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
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(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850	3,850

(重要な後発事象)

当社は、平成30年9月28日付で締結した、S M A Mとの合併契約書に基づき、当社を消滅会社とし、S M A Mを存続会社とする吸収合併方式により、平成31年4月1日付で合併いたしました。

#### 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 通常の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

(イ) 定款の変更

- a. 2018年11月1日付で、発行可能株式総数を変更する定款の変更を行いました。
- b. 2019年4月1日付で、取締役の員数の上限を変更する等の定款の変更を行いました。

(ロ) その他の重要事項

三井住友アセットマネジメント株式会社は、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更しました。

ロ 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(2019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(2019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	
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円	
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	
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	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、2019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】

(持株比率5%以上を記載しています。)

該当ありません。

## 第3【その他】

### 1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

(1)「金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である。」旨を記載することがあります。

(2)委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。

(3)委託会社のホームページのアドレスおよび他のインターネットのアドレス(これらのアドレスをコード化した図形等も含む)を記載することがあります。

- (4) 請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。
  - (5) 目論見書の使用開始日を記載することがあります。
  - (6) 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。
  - (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきであることを記載することがあります。
  - (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
  - (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
  - (10) 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を記載することがあります。
  - (11) 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があります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
  - 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
  - 4 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。
  - 5 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。
  - 6 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。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)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

令和1年6月14日

三井住友DS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、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34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DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 三井住友アセットマネジメント株式会社）の平成31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、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。

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31年1月8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の平成30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

令和1年7月9日

三井住友DS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30年12月1日から令和1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令和1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30年12月1日から令和1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DS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. XBR Lデータは

中間監査の対象には含まれていません。