【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	令和2年2月27日提出
【計算期間】	第17期(自　平成30年12月1日至　令和1年12月2日)
【ファンド名】	三井住友・日本株式インデックス年金ファンド
【発行者名】	三井住友ＤＳ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
【連絡場所】	東京都港区愛宕二丁目５番１号
【電話番号】	03-5405-0784
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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　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5,000億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。

（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す。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
追加型	海外	債券	特殊型
	内外	不動産投信	
		その他資産 （　）	
		資産複合	

（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 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル		
	年2回	日本		日経225
	年4回	北米		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 （　）	年6回（隔月）	欧州	ファミリーファンド	
	年12回（毎月）	アジア		
	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）） 資産複合 （　） 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東（中東）		その他 （　）
		エマージング		

（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】

2003年２月21日　　信託契約締結、設定、運用開始。

（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ＤＳアセットマネジメント株式会社」

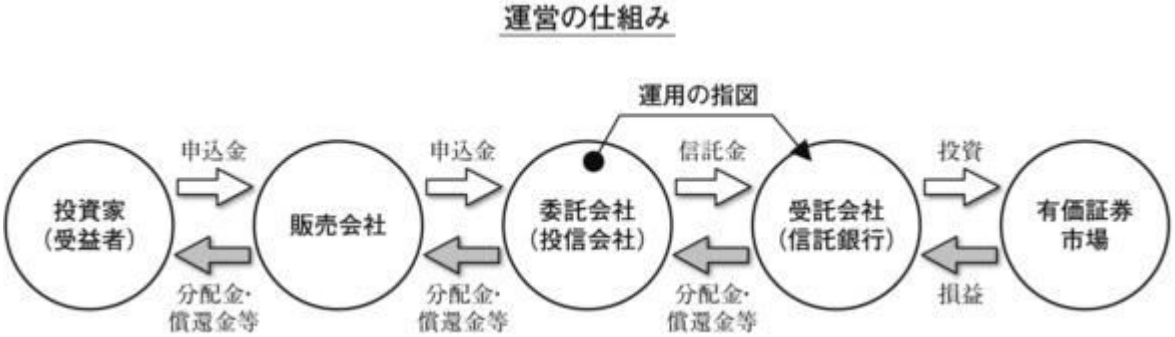
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書（目論見書）および運用報告書の作成等を行います。

（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、その業務を行うに充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。

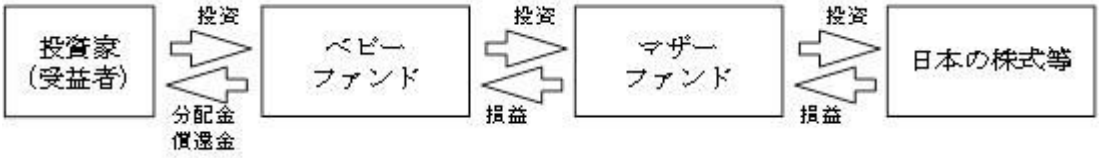
（ハ）販売会社

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。



※　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。



ロ　委託会社の概況

（イ）資本金の額

20億円（2019年12月30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ＤＳ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12月30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）主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、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）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券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。

（ハ）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。

（ニ）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。

ファンドの特色

1 主としてマザーファンドへの投資を通じて、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）の動き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

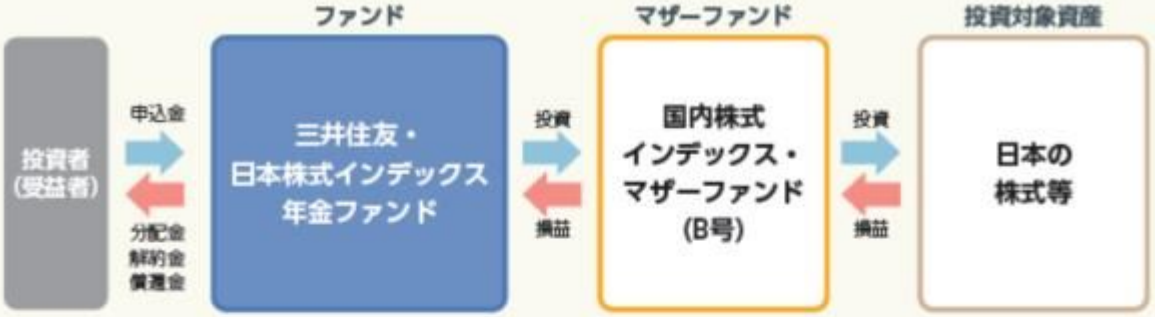
東京証券取引所第1部に上場しているすべての銘柄（内国普通株式）の時価総額を指数化し株式市場の動向を捉えようとするものであり、東京証券取引所が算出、公表を行っています。
TOPIXは、東京証券取引所の知的財産で、この指数の算出、数値の公表、利用などこの指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有します。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

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。

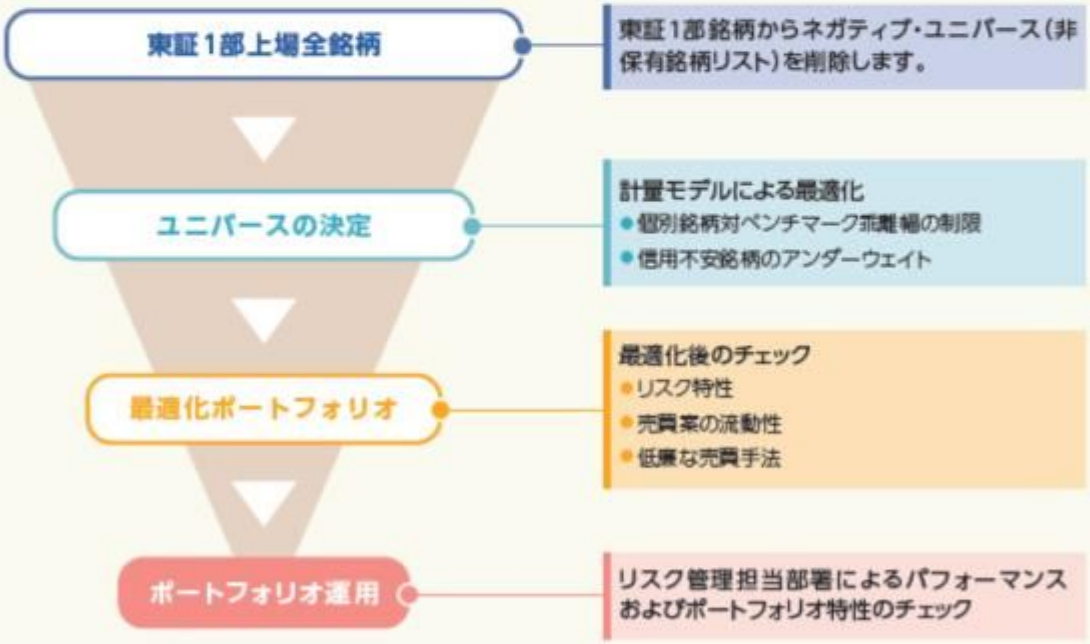
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

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。

※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。

（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（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。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．金銭債権

４．約束手形

（ロ）次に掲げる特定資産以外の資産

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および次の有価証券（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、かつ本邦通貨表示のものに限ります。）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。）

なお、第１号の証券または証書を以下「株式」といい、第２号および第３号の証券を以下「公社債」といいます。

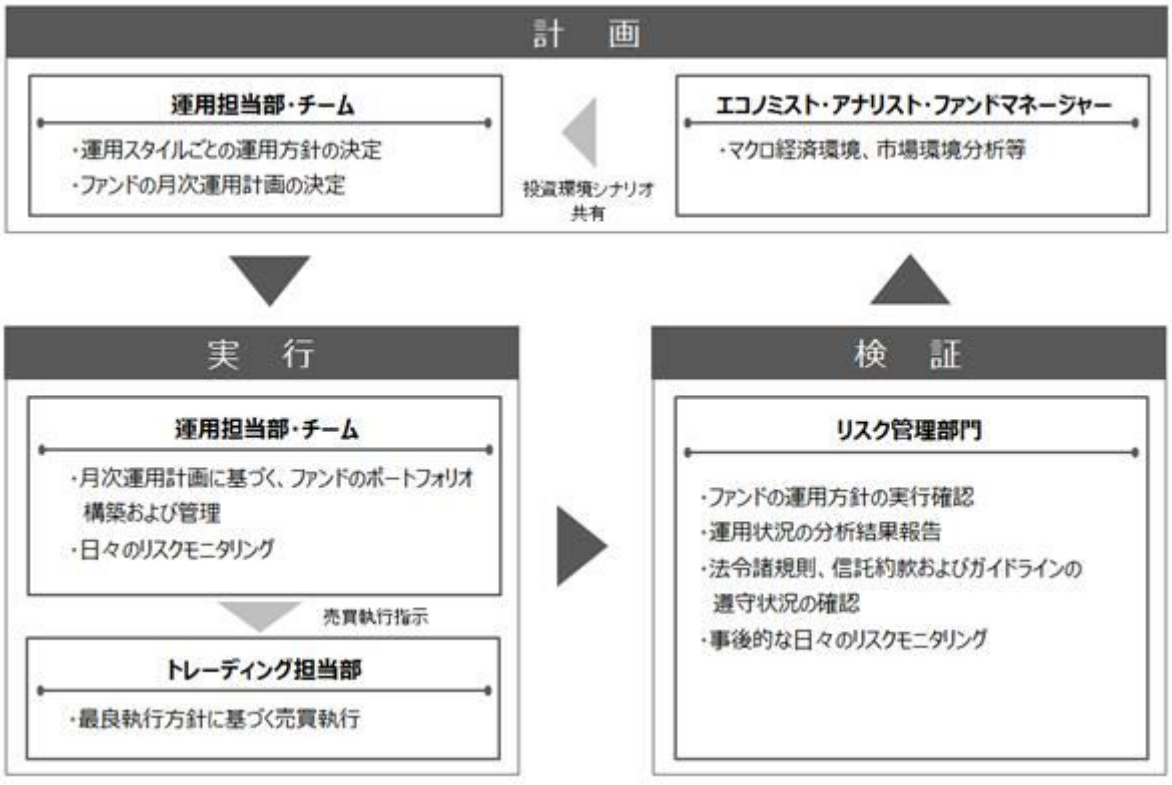
ハ　投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記ロ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

（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）【分配方針】

年１回（原則として11月30日。休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、決算毎に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（評価益を含みます。）等の全額とします。

ロ　分配金額は、委託会社が基準価額の水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等や委託会社の判断によっては、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　収益の分配に充てず信託財産内に留保した利益については、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

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】

Ⅰ　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。）。

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。

Ⅱ　ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ　投資する株式の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式は、日本の取引所に上場している株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。

（ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場され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できるものとします。

ロ　先物取引等の運用指図、目的、範囲

委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、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。以下同じ。）、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。以下同じ。）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。以下同じ。）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るものとします。

ハ　有価証券の貸付けの指図および範囲

（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たときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ニ　資金の借入れ

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用および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、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

（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、信託財産中より支弁します。

ホ　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。

III　法令に基づく投資制限

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

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

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

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

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

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

（参考情報：国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）の投資方針等）

（１）投資方針等

イ　基本方針

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

ロ　投資態度

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

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

（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

前記「２　投資方針　（２）投資対象　ロ　投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第１号から第７号に同じです。

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に同じです。

（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、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資者の投資元本は保証されているものではなく、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。

運用の結果として信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。また、一定の投資成果を保証するものではありません。

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

（イ）株式市場リスク

内外の政治、経済、社会情勢等の影響により株式相場が下落した場合、ファンドの基準価額が下落する要因となります。また、個々の株式の価格はその発行企業の事業活動や財務状

況、これらに対する外部的評価の変化等によって変動し、ファンドの基準価額が下落する要因となります。特に、企業が倒産や大幅な業績悪化に陥った場合、当該企業の株式の価値が大きく下落し、基準価額が大きく下落する要因となります。

（ロ）信用リスク

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

（ハ）市場流動性リスク

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

（ニ）指数の動きと連動しない要因

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

（ホ）ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

（ヘ）換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受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は異なります。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。
※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

ありません。

（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0.275%（税抜き0.25%）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。
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0.1%	ファンドの運用等の対価
販売会社	年0.11%	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0.04%	ファンドの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

※上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

（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、年25,300円（税抜き23,000円）を上限として、日割りした金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
ロ　信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
ハ　有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

※　上記ロ、ハにかかる費用に関しましては、その時々の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ったりすることから、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。）

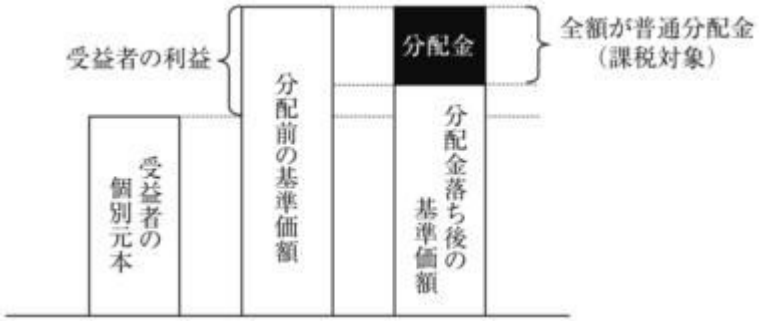
ロ　一部解約時および償還時の課税について

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。

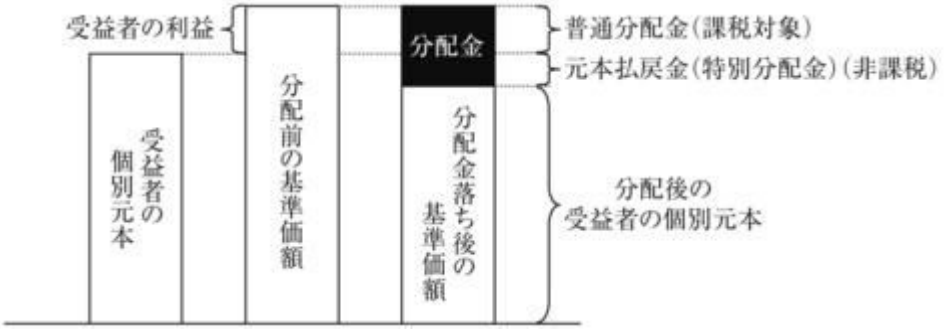
ハ　収益分配金の課税について

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。

①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。



②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①、②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。

ニ　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

ｉ．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。

ii．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。ただし、販売会社によっては当ファンドをＮＩＳＡ、ジュニア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。益金不算入制度の適用はありません。

※NISA、ジュニアNISAをご利用になる場合、各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。

	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	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5年間（投資期間は2023年まで）	
利用できる限度額	120万円／年（最大600万円）	80万円／年（最大400万円）

※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。

※外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
※受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。
※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12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・日本株式インデックス年金ファンド

2019年12月30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	27,468,836,947	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	△5,786,413	△0.02
合計(純資産総額)		27,463,050,534	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

イ　主要投資銘柄

2019年12月30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）	9,986,126,058	2.7360	27,322,281,991	2.7507	27,468,836,947	100.02

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12月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.02
合計	100.02

②【投資不動産物件】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

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8期 (2010年11月30日)	8,594,601,878	8,594,601,878	11,172	11,172
第9期 (2011年11月30日)	8,322,277,845	8,322,277,845	9,656	9,656
第10期 (2012年11月30日)	9,844,615,684	9,844,615,684	10,577	10,577
第11期 (2013年12月 2日)	16,669,083,903	16,669,083,903	17,321	17,321
第12期 (2014年12月 1日)	19,103,300,879	19,103,300,879	19,898	19,898
第13期 (2015年11月30日)	21,767,535,950	21,767,535,950	22,472	22,472
第14期 (2016年11月30日)	22,218,652,970	22,218,652,970	21,289	21,289
第15期 (2017年11月30日)	26,401,156,315	26,401,156,315	26,454	26,454
第16期 (2018年11月30日)	26,819,215,931	26,819,215,931	25,113	25,113
第17期 (2019年12月 2日)	27,580,373,795	27,580,373,795	26,416	26,416
2018年12月末日	24,135,846,249	—	22,536	—
2019年 1月末日	25,505,055,675	—	23,638	—
2月末日	26,041,992,526	—	24,250	—
3月末日	26,009,241,773	—	24,265	—
4月末日	25,914,960,739	—	24,665	—
5月末日	24,487,837,958	—	23,055	—
6月末日	25,145,553,439	—	23,679	—
7月末日	25,276,810,707	—	23,889	—
8月末日	24,721,668,066	—	23,076	—
9月末日	25,951,928,252	—	24,466	—
10月末日	27,014,939,262	—	25,689	—
11月末日	27,355,098,135	—	26,182	—
12月末日	27,463,050,534	—	26,553	—

②【分配の推移】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第8期	2009年12月 1日～2010年11月30日	0

第9期	2010年12月 1日～2011年11月30日	0
第10期	2011年12月 1日～2012年11月30日	0
第11期	2012年12月 1日～2013年12月 2日	0
第12期	2013年12月 3日～2014年12月 1日	0
第13期	2014年12月 2日～2015年11月30日	0
第14期	2015年12月 1日～2016年11月30日	0
第15期	2016年12月 1日～2017年11月30日	0
第16期	2017年12月 1日～2018年11月30日	0
第17期	2018年12月 1日～2019年12月 2日	0

③【収益率の推移】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

	収益率（%）
第8期	4.2
第9期	△13.6
第10期	9.5
第11期	63.8
第12期	14.9
第13期	12.9
第14期	△5.3
第15期	24.3
第16期	△5.1
第17期	5.2

（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落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

（４）【設定及び解約の実績】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第8期	1,899,478,919	698,410,230
第9期	1,980,301,744	1,054,324,453
第10期	1,867,808,738	1,178,961,753
第11期	3,617,090,901	3,300,844,517
第12期	2,724,295,913	2,747,487,141
第13期	3,852,586,112	3,766,659,896
第14期	3,454,541,463	2,704,530,895
第15期	2,900,377,274	3,357,020,358

第16期	2,775,404,878	2,076,030,207
第17期	1,986,452,845	2,225,029,044

（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12月30日現在

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	171,041,505,050	98.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	―	2,907,830,843	1.67
合計(純資産総額)		173,949,335,893	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	2,822,440,000	1.62
合計	買建	―	2,822,440,000	1.62

（２）投資資産

①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12月30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	784,200	7,738.00	6,068,139,600	7,714.00	6,049,318,800	3.48
日本	株式	ソニー	電気機器	444,900	6,998.00	3,113,410,200	7,401.00	3,292,704,900	1.89
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	4,780,600	582.10	2,782,787,260	593.20	2,835,851,920	1.63
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	548,100	4,236.00	2,321,751,600	4,756.00	2,606,763,600	1.50

日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	923,600	2,799.00	2,585,156,400	2,757.00	2,546,365,200	1.46
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	585,600	4,491.00	2,629,929,600	4,332.00	2,536,819,200	1.46
日本	株式	キーエンス	電気機器	63,800	37,970.00	2,422,486,000	38,490.00	2,455,662,000	1.41
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	481,700	3,978.00	1,916,202,600	4,099.00	1,974,488,300	1.14
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	480,300	4,008.00	1,925,042,400	4,038.00	1,939,451,400	1.11
日本	株式	任天堂	その他製品	43,200	43,240.00	1,867,968,000	43,970.00	1,899,504,000	1.09
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	554,300	3,104.00	1,720,547,200	3,099.00	1,717,775,700	0.99
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	514,800	3,150.00	1,621,620,000	3,253.00	1,674,644,400	0.96
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,433,600	169.70	1,600,881,920	168.30	1,587,674,880	0.91
日本	株式	日立製作所	電気機器	338,300	4,309.00	1,457,734,700	4,626.00	1,564,975,800	0.90
日本	株式	ＮＴＴドコモ	情報・通信業	510,100	3,007.00	1,533,870,700	3,038.00	1,549,683,800	0.89
日本	株式	花王	化学	168,500	8,708.00	1,467,298,000	9,025.00	1,520,712,500	0.87
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	248,300	6,020.00	1,494,766,000	6,119.00	1,519,347,700	0.87
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	140,600	10,025.00	1,409,515,000	10,450.00	1,469,270,000	0.84
日本	株式	第一三共	医薬品	201,400	7,012.00	1,412,216,800	7,228.00	1,455,719,200	0.84
日本	株式	信越化学工業	化学	118,400	11,905.00	1,409,552,000	12,060.00	1,427,904,000	0.82
日本	株式	三菱商事	卸売業	486,700	2,907.50	1,415,080,250	2,900.00	1,411,430,000	0.81
日本	株式	村田製作所	電気機器	206,800	6,529.00	1,350,197,200	6,746.00	1,395,072,800	0.80
日本	株式	ダイキン工業	機械	89,700	15,770.00	1,414,569,000	15,450.00	1,385,865,000	0.80
日本	株式	ファナック	電気機器	66,900	21,240.00	1,420,956,000	20,330.00	1,360,077,000	0.78
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	58,500	22,245.00	1,301,332,500	22,000.00	1,287,000,000	0.74
日本	株式	日本電産	電気機器	84,700	16,325.00	1,382,727,500	15,005.00	1,270,923,500	0.73
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	484,900	2,438.00	1,182,186,200	2,534.50	1,228,979,050	0.71
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	124,000	10,085.00	1,250,540,000	9,858.00	1,222,392,000	0.70
日本	株式	三井物産	卸売業	609,200	1,967.50	1,198,601,000	1,946.00	1,185,503,200	0.68
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	619,500	1,898.00	1,175,811,000	1,870.00	1,158,465,000	0.67

ロ　種類別・業種別の投資比率

2019年12月30日現在

種類	国内／外国	業種	投資比率（%）
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.29
		建設業	2.77
		食料品	3.71
		繊維製品	0.58
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.02
		医薬品	5.92
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.69

		ガラス・土石製品	0.84
		鉄鋼	0.76
		非鉄金属	0.76
		金属製品	0.58
		機械	5.03
		電気機器	14.15
		輸送用機器	7.58
		精密機器	2.34
		その他製品	2.29
		電気・ガス業	1.51
		陸運業	4.31
		海運業	0.17
		空運業	0.49
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.57
		卸売業	4.91
		小売業	4.56
		銀行業	5.76
		証券、商品先物取引業	0.81
		保険業	2.28
		その他金融業	1.16
		不動産業	2.38
		サービス業	5.09
合計			98.33

②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。

③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12月30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	164	日本円	2,824,315,400	2,822,440,000	1.62

（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12月30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
2019年12月	0円
2018年11月	0円
2017年11月	0円
2016年11月	0円
2015年11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・日本株式インデックス年金ファンド

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	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.02
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)	100.02

■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	98.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.67
合計(純資産総額)		100.00

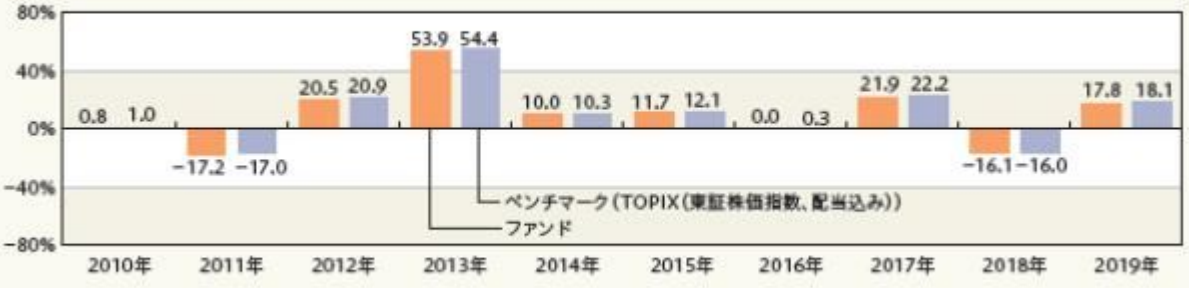
※株価指数先物取引の買建て 1.62%

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	3.48
日本	株式	ソニー	電気機器	1.89
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.63
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.50
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.46
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.46
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.41
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.14
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.11
日本	株式	任天堂	その他製品	1.09

※比率は、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)



※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

ありません。

ニ　申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社にお問い合わせください。

ホ　照会先

手続き等のご不明な点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ＤＳアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	https://www.smd-am.co.jp

※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。

ヘ　申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト　払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。
各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

２【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。
解約請求のお申込みに関しては、原則として午後３時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。
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４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、「日株イン」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	https://www.smd-am.co.jp

※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】

2003年２月21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、受益権口数が30億口を下回ったとき、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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

ｃ．上記ｂの公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

ｄ．上記ｃの一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、信託契約の解約をしません。

ｅ．委託会社は、当ファンドの信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ｆ．上記ｃ～ｅまでの取扱いは、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記ｃの一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

（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。

（ハ）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。

（ニ）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、受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。

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、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あるため、将来の分配金の支払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ます。）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ます。）に支払われます。

ハ　信託約款の変更

（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ができるものとし、あらかじめ、変更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）の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

（ハ）上記（ロ）の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

（ニ）上記（ハ）の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の２分の１を超えるときは、（イ）の信託約款の変更をしません。

（ホ）委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ニ　反対者の買取請求権

当ファンドの信託契約の解約または重大な信託約款の変更が行われる場合において、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間内に委託会社に異議を述べた受益者は、自己に帰属する受益権を、受託会社に信託財産をもって買い取るよう請求をすることができます。

ホ　販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の３ヵ月前に当事者のいずれからも、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応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して５営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払われます。

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

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

ロ　償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して５営業日目まで）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ます。）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　信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

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を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に異議のある受益

者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となるときは、当該解約または信託約款変更は行われません。

当該解約または信託約款変更が行われる場合において、前述の異議を申し立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

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17期（平成30年12月 1日から令和 1年12月 2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・日本株式インデックス年金ファンド】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第16期 （平成30年11月30日現在）	第17期 （令和 1年12月 2日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	21,117,220	-
コール・ローン	3,857,937	38,699,037
親投資信託受益証券	26,855,731,271	27,615,888,788
未収入金	12,669,495	46,410,640
流動資産合計	26,893,375,923	27,700,998,465
資産合計	26,893,375,923	27,700,998,465
負債の部		
流動負債		
未払解約金	37,637,124	85,100,782
未払受託者報酬	5,841,366	5,681,713
未払委託者報酬	30,667,134	29,828,938
未払利息	11	74
その他未払費用	14,357	13,163
流動負債合計	74,159,992	120,624,670
負債合計	74,159,992	120,624,670
純資産の部		
元本等		
元本	10,679,234,992	10,440,658,793
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	16,139,980,939	17,139,715,002
元本等合計	26,819,215,931	27,580,373,795
純資産合計	26,819,215,931	27,580,373,795
負債純資産合計	26,893,375,923	27,700,998,465

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第16期 自　平成29年12月 1日 至　平成30年11月30日	第17期 自　平成30年12月 1日 至　令和 1年12月 2日
営業収益		
有価証券売買等損益	△1,291,501,626	1,459,869,105
営業収益合計	△1,291,501,626	1,459,869,105
営業費用		
支払利息	17,502	13,999
受託者報酬	11,590,215	11,141,091
委託者報酬	60,848,547	58,490,603
その他費用	36,638	32,880
営業費用合計	72,492,902	69,678,573
営業利益又は営業損失（△）	△1,363,994,528	1,390,190,532
経常利益又は経常損失（△）	△1,363,994,528	1,390,190,532
当期純利益又は当期純損失（△）	△1,363,994,528	1,390,190,532
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（△）	△45,255,977	△166,475,574
期首剰余金又は期首欠損金（△）	16,421,295,994	16,139,980,939
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,452,785,121	2,776,380,930
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	4,452,785,121	2,776,380,930
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,415,361,625	3,333,312,973
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,415,361,625	3,333,312,973
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（△）	16,139,980,939	17,139,715,002

（３）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項　目	第17期 自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。 （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。 （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。 （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。
2.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成30年12月 1日から令和 1年12月 2日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項　目		第16期 （平成30年11月30日現在）	第17期 （令和 1年12月 2日現在）
1．当計算期間の末日における受益権の総数		10,679,234,992口	10,440,658,793口
2．1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.5113円	1口当たり純資産額　2.6416円
	(10,000口当たりの純資産額	25,113円)	(10,000口当たりの純資産額　26,416円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項　目	第16期 自 平成29年12月 1日 至 平成30年11月30日	第17期 自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2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（528,680,154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（12,722,939,879円）、および分配準備積立金（5,933,598,495円）より、分配対象収益は19,185,218,528円（1万口当たり17,964.95円）でありますが、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（600,223,383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（13,523,253,522円）、および分配準備積立金（5,239,349,664円）より、分配対象収益は19,362,826,569円（1万口当たり18,545.59円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	第17期 自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2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	(1)金融商品の内容 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。 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、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 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 (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。

項　目	第17期 自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2日
3 .金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、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会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 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、上下限値、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、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、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、当該関連運用部署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、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 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会議にて、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。
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。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	第17期 （令和 1年12月 2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（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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第16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	△1,266,320,676円
合計	△1,266,320,676円

第17期（自 平成30年12月 1日　至 令和 1年12月 2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	1,557,488,080円
合計	1,557,488,080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17期 自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2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16期 （平成30年11月30日現在）	第17期 （令和 1年12月 2日現在）
期首元本額	9,979,860,321円	10,679,234,992円
期中追加設定元本額	2,775,404,878円	1,986,452,845円
期中一部解約元本額	2,076,030,207円	2,225,029,044円

（４）【附属明細表】

①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）	10,093,895,533	27,615,888,788	
合計		10,093,895,533	27,615,888,788	

②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・日本株式インデックス年金ファンドは、「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30年11月30日現在）	（令和 1年12月 2日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	3,283,915,460	-
コール・ローン	599,943,591	3,379,265,534
株式	168,579,248,010	170,406,746,760
派生商品評価勘定	134,774,480	72,516,400
未収入金	80,584,796	382,800
未収配当金	1,095,772,321	857,351,048
差入委託証拠金	26,595,000	44,895,000
流動資産合計	173,800,833,658	174,761,157,542
資産合計	173,800,833,658	174,761,157,542
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,694,840	-
前受金	132,395,000	72,655,000
未払金	1,592,960	-
未払解約金	116,111,681	290,138,959
未払利息	1,758	6,480
その他未払費用	263,041	63,122
流動負債合計	253,059,280	362,863,561
負債合計	253,059,280	362,863,561
純資産の部		
元本等		

	（平成30年11月30日現在）	（令和 1年12月 2日現在）
元本	66,912,228,971	63,743,430,458
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	106,635,545,407	110,654,863,523
元本等合計	173,547,774,378	174,398,293,981
純資産合計	173,547,774,378	174,398,293,981
負債純資産合計	173,800,833,658	174,761,157,542

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12月 2日
1.有価証券の評価基準及び評価方法	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。 (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。 (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。 (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。
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

項　目	（平成30年11月30日現在）	（令和 1年12月 2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。	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　2,721,200,000円	株式　3,095,200,000円
2．　当計算期間の末日における受益権の総数	66,912,228,971口	63,743,430,458口
3．　1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額　2.5937円 (10,000口当たりの純資産額　25,937円)	1口当たり純資産額　2.7359円 (10,000口当たりの純資産額　27,359円)

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．金融商品の状況に関する事項

項　目	自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2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	(1)金融商品の内容 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。 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。 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 (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。
3.金融商品に係るリスク管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、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会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。 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、上下限値、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、関連する運用部署に是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用部署は、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、当該関連運用部署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、当該関連運用部署の担当役員およびリスク管理会議へ報告を行う体制となっております。 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会議にて、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。

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。

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項　目	（令和 1年12月 2日現在）
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成30年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	うち１年超	時　価	評価損益
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

（令和 1年12月 2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	うち１年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				

	買建	3,926,928,600	-	3,999,445,000	72,516,400
	東証株価指数先物	3,926,928,600	-	3,999,445,000	72,516,400
合計		3,926,928,600	-	3,999,445,000	72,516,400

（注）１．時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

２．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成30年12月 1日 至 令和 1年12月 2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・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	768,941,629円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	3,698,515,899円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	2,692,088,576円
ＳＭＡＭ・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・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	7,445,740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）	24,782,474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）	62,529,551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）	87,629,751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）	51,789,894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）	131,284,628円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,987,526,237円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・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

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＞	35,005,032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＞	86,203,195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＞	20,774円
合計	66,912,228,971円

（令和 1年12月 2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	13,207,087,179円
同期中における一部解約元本額	16,375,885,692円
令和 1年12月 2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	10,093,895,533円
三井住友・ＤＣ年金バランス３０（債券重点型）	871,994,826円
三井住友・ＤＣ年金バランス５０（標準型）	4,134,711,529円
三井住友・ＤＣ年金バランス７０（株式重点型）	2,984,021,207円
ＳＭＡＭ・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	171,270,930円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０２０（４資産タイプ）	6,770,604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）	24,018,495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）	65,633,993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）	108,427,212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）	71,148,493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）	157,127,838円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	1,522,887,951円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・日本株インデックスファンド	11,405,867,081円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	750,808,584円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	754,464,975円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	588,252,205円
イオン・バランス戦略ファンド	102,533,812円
三井住友・ＤＣターゲットイヤーファンド２０５０	11,657,198円
三井住友・資産最適化ファンド（１安定重視型）	55,140,191円
三井住友・資産最適化ファンド（２やや安定型）	50,085,566円
三井住友・資産最適化ファンド（３バランス型）	139,661,373円
三井住友・資産最適化ファンド（４やや成長型）	75,363,090円
三井住友・資産最適化ファンド（５成長重視型）	94,884,854円
三井住友・ＤＣつみたてＮＩＳＡ・世界分散ファンド	12,899,750円
三井住友ＤＳ・国内株式インデックス年金ファンド	407,382円
三井住友ＤＳ・年金バランス３０（債券重点型）	77,860円
三井住友ＤＳ・年金バランス５０（標準型）	137,846円
三井住友ＤＳ・年金バランス７０（株式重点型）	198,857円
ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	3,810,058,037円
バランスファンドＶＡ（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	22,375,907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＞	218,475,561円

ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	3,018,643,305円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	2,309,967,382円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	8,366,581,213円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	55,996,005円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	212,637,976円
世界６資産バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	794,882円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	882,312,334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＞	55,058,558円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	363,346,655円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	1,058,492,761円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	861,659,534円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	2,778,991,517円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	1,137,750円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	58,214,802円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	71,457,145円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	44,386,681円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	21,663,542円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	179,161,011円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	345,072,882円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ＜適格機関投資家専用＞	11,140,518円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	111,594,783円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	58,092,653円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	9,215,706円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	70,883,973円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	848,254,810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）	194,795,060円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ２＜適格機関投資家専用＞	19,380,760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＞	1,164,508,623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＞	193,275,461円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,504,949,363円
ＳＭＡＭ・世界バランスファンドＶＡ２＜適格機関投資家限定＞	111,253,748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＞	14,465,450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＞	81,986,207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＞	51,058,228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Ⅱ＜適格機関投資家限定＞	307,740,440円
合計	63,743,430,458円

附属明細表

①有価証券明細表

(a)株式

（単位：円）

		評価額	

銘　柄	株　数	単価	金額	備考
極洋	3,600	2,905.00	10,458,000	
日本水産	95,800	666.00	63,802,800	
マルハニチロ	13,800	2,938.00	40,544,400	
カネコ種苗	4,300	1,522.00	6,544,600	
サカタのタネ	10,900	3,535.00	38,531,500	
ホクト	7,200	2,001.00	14,407,200	
日鉄鉱業	2,500	4,570.00	11,425,000	
三井松島ホールディングス	3,300	1,203.00	3,969,900	
国際石油開発帝石	384,900	1,061.50	408,571,350	
石油資源開発	12,400	2,839.00	35,203,600	
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	5,300	1,577.00	8,358,100	
ヒノキヤグループ	3,200	2,233.00	7,145,600	
ショーボンドホールディングス	13,500	4,260.00	57,510,000	
ミライト・ホールディングス	27,600	1,638.00	45,208,800	
タマホーム	5,500	1,842.00	10,131,000	
スペースバリューホールディングス	13,800	515.00	7,107,000	
安藤・間	57,300	905.00	51,856,500	
東急建設	28,000	784.00	21,952,000	
コムシスホールディングス	33,800	3,190.00	107,822,000	
ミサワホーム	8,500	1,198.00	10,183,000	
ビーアールホールディングス	13,000	484.00	6,292,000	
高松コンストラクショングループ	6,000	2,733.00	16,398,000	
東建コーポレーション	2,800	7,300.00	20,440,000	
大成建設	73,400	4,345.00	318,923,000	
大林組	220,700	1,180.00	260,426,000	
清水建設	223,800	1,065.00	238,347,000	
飛島建設	8,000	1,470.00	11,760,000	
長谷工コーポレーション	84,400	1,428.00	120,523,200	
松井建設	11,200	782.00	8,758,400	
錢高組	1,300	4,005.00	5,206,500	
鹿島建設	172,200	1,460.00	251,412,000	
不動テトラ	7,000	1,543.00	10,801,000	
大末建設	5,400	964.00	5,205,600	
鉄建建設	5,100	2,846.00	14,514,600	
西松建設	17,700	2,434.00	43,081,800	
三井住友建設	56,000	610.00	34,160,000	
大豊建設	5,100	2,999.00	15,294,900	
前田建設工業	56,700	994.00	56,359,800	
奥村組	12,600	3,095.00	38,997,000	
東鉄工業	9,000	3,275.00	29,475,000	
淺沼組	3,000	4,375.00	13,125,000	

戸田建設	92,700	682.00	63,221,400	
熊谷組	10,300	3,275.00	33,732,500	
北野建設	2,000	2,606.00	5,212,000	
矢作建設工業	12,100	764.00	9,244,400	
ピーエス三菱	10,600	699.00	7,409,400	
日本ハウスホールディングス	20,000	482.00	9,640,000	
大東建託	26,500	13,355.00	353,907,500	
新日本建設	10,400	928.00	9,651,200	
ＮＩＰＰＯ	17,700	2,256.00	39,931,200	
東亜道路工業	1,800	3,455.00	6,219,000	
前田道路	23,200	2,602.00	60,366,400	
日本道路	2,300	7,010.00	16,123,000	
東亜建設工業	8,300	1,577.00	13,089,100	
日本国土開発	15,000	626.00	9,390,000	
若築建設	5,300	1,701.00	9,015,300	
東洋建設	26,100	504.00	13,154,400	
五洋建設	89,300	637.00	56,884,100	
世紀東急工業	13,300	884.00	11,757,200	
福田組	2,800	4,825.00	13,510,000	
住友林業	55,300	1,594.00	88,148,200	
日本基礎技術	12,200	403.00	4,916,600	
巴コーポレーション	14,400	399.00	5,745,600	
大和ハウス工業	218,400	3,395.00	741,468,000	
ライト工業	12,600	1,587.00	19,996,200	
積水ハウス	241,500	2,394.50	578,271,750	
ユアテック	13,800	677.00	9,342,600	
中電工	8,200	2,582.00	21,172,400	
関電工	29,200	1,054.00	30,776,800	
きんでん	51,800	1,659.00	85,936,200	
東京エネシス	9,400	938.00	8,817,200	
トーエネック	2,900	3,640.00	10,556,000	
住友電設	6,300	2,469.00	15,554,700	
日本電設工業	11,200	2,268.00	25,401,600	
協和エクシオ	33,300	2,877.00	95,804,100	
新日本空調	6,100	2,242.00	13,676,200	
九電工	15,500	3,545.00	54,947,500	
三機工業	15,700	1,480.00	23,236,000	
日揮ホールディングス	68,600	1,622.00	111,269,200	
中外炉工業	3,200	1,708.00	5,465,600	
ヤマト	9,400	722.00	6,786,800	
太平電業	5,700	2,333.00	13,298,100	
高砂熱学工業	18,600	1,901.00	35,358,600	

朝日工業社	2,100	3,470.00	7,287,000	
明星工業	14,700	930.00	13,671,000	
大氣社	10,700	3,705.00	39,643,500	
ダイダン	5,500	2,632.00	14,476,000	
日比谷総合設備	7,400	1,949.00	14,422,600	
東芝プラントシステム	17,000	2,664.00	45,288,000	
ＯＳＪＢホールディングス	41,700	271.00	11,300,700	
レイズネクスト	12,600	1,242.00	15,649,200	
日本製粉	20,200	1,716.00	34,663,200	
日清製粉グループ本社	79,400	2,058.00	163,405,200	
昭和産業	6,100	3,230.00	19,703,000	
鳥越製粉	8,500	945.00	8,032,500	
中部飼料	8,900	1,390.00	12,371,000	
フィード・ワン	53,400	170.00	9,078,000	
日本甜菜製糖	4,700	2,040.00	9,588,000	
三井製糖	5,900	2,320.00	13,688,000	
日新製糖	3,400	2,019.00	6,864,600	
森永製菓	16,500	5,610.00	92,565,000	
中村屋	2,500	4,470.00	11,175,000	
江崎グリコ	21,000	5,090.00	106,890,000	
名糖産業	4,900	1,315.00	6,443,500	
井村屋グループ	3,800	2,058.00	7,820,400	
不二家	4,300	2,214.00	9,520,200	
山崎製パン	53,300	2,036.00	108,518,800	
モロゾフ	1,700	4,970.00	8,449,000	
亀田製菓	4,000	5,030.00	20,120,000	
寿スピリッツ	6,700	7,660.00	51,322,000	
カルビー	32,200	3,560.00	114,632,000	
森永乳業	13,300	4,635.00	61,645,500	
六甲バター	5,300	1,808.00	9,582,400	
ヤクルト本社	48,500	6,530.00	316,705,000	
明治ホールディングス	46,500	7,530.00	350,145,000	
雪印メグミルク	17,100	2,666.00	45,588,600	
プリマハム	10,700	2,554.00	27,327,800	
日本ハム	26,900	4,650.00	125,085,000	
丸大食品	7,000	2,341.00	16,387,000	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	5,400	3,005.00	16,227,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	45,300	718.00	32,525,400	
サッポロホールディングス	24,400	2,679.00	65,367,600	
アサヒグループホールディングス	148,000	5,266.00	779,368,000	
キリンホールディングス	299,600	2,441.50	731,473,400	
宝ホールディングス	53,700	1,074.00	57,673,800	

オエノンホールディングス	22,200	405.00	8,991,000	
養命酒製造	3,500	2,000.00	7,000,000	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	49,800	2,646.00	131,770,800	
サントリー食品インターナショナル	47,000	4,755.00	223,485,000	
ダイドーグループホールディングス	3,500	4,635.00	16,222,500	
伊藤園	21,300	5,540.00	118,002,000	
キーコーヒー	6,700	2,399.00	16,073,300	
日清オイリオグループ	8,800	3,920.00	34,496,000	
不二製油グループ本社	17,300	3,075.00	53,197,500	
かどや製油	1,300	3,815.00	4,959,500	
Ｊ－オイルミルズ	3,600	4,365.00	15,714,000	
キッコーマン	50,600	5,600.00	283,360,000	
味の素	157,200	1,836.00	288,619,200	
キユーピー	39,400	2,456.00	96,766,400	
ハウス食品グループ本社	26,300	3,840.00	100,992,000	
カゴメ	27,100	2,688.00	72,844,800	
焼津水産化学工業	5,700	1,052.00	5,996,400	
アリアケジャパン	6,400	7,880.00	50,432,000	
ニチレイ	33,600	2,581.00	86,721,600	
東洋水産	36,100	4,745.00	171,294,500	
イートアンド	3,700	1,785.00	6,604,500	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,400	1,207.00	5,310,800	
日清食品ホールディングス	29,900	8,230.00	246,077,000	
永谷園ホールディングス	4,200	2,152.00	9,038,400	
一正蒲鉾	4,300	1,063.00	4,570,900	
フジッコ	7,600	2,011.00	15,283,600	
ロック・フィールド	7,800	1,480.00	11,544,000	
日本たばこ産業	407,700	2,516.50	1,025,977,050	
ケンコーマヨネーズ	4,400	2,602.00	11,448,800	
わらべや日洋ホールディングス	5,100	1,819.00	9,276,900	
なとり	5,400	1,700.00	9,180,000	
ピックルスコーポレーション	2,000	2,785.00	5,570,000	
北の達人コーポレーション	23,600	704.00	16,614,400	
ユーグレナ	29,100	836.00	24,327,600	
ミヨシ油脂	4,300	1,291.00	5,551,300	
理研ビタミン	3,000	4,065.00	12,195,000	
片倉工業	11,100	1,378.00	15,295,800	
グンゼ	5,100	5,200.00	26,520,000	
東洋紡	28,200	1,622.00	45,740,400	
ユニチカ	23,700	376.00	8,911,200	
富士紡ホールディングス	3,900	3,480.00	13,572,000	
倉敷紡績	7,100	2,582.00	18,332,200	

日本毛織	22,500	1,075.00	24,187,500	
ダイドーリミテッド	15,000	280.00	4,200,000	
帝国繊維	8,300	2,042.00	16,948,600	
帝人	55,300	2,096.00	115,908,800	
東レ	500,400	738.00	369,295,200	
住江織物	2,600	2,852.00	7,415,200	
アツギ	9,600	829.00	7,958,400	
ダイニック	6,400	768.00	4,915,200	
セーレン	16,900	1,560.00	26,364,000	
小松マテーレ	12,800	830.00	10,624,000	
ワコールホールディングス	18,200	3,085.00	56,147,000	
ホギメディカル	8,000	3,610.00	28,880,000	
レナウン	35,000	115.00	4,025,000	
ＴＳＩホールディングス	24,500	553.00	13,548,500	
マツオカコーポレーション	2,800	2,197.00	6,151,600	
ワールド	10,000	2,766.00	27,660,000	
三陽商会	5,100	1,407.00	7,175,700	
オンワードホールディングス	41,700	643.00	26,813,100	
ゴールドウイン	12,600	7,940.00	100,044,000	
デサント	13,900	1,810.00	25,159,000	
特種東海製紙	4,400	4,055.00	17,842,000	
王子ホールディングス	285,300	632.00	180,309,600	
日本製紙	30,700	1,935.00	59,404,500	
三菱製紙	11,700	508.00	5,943,600	
北越コーポレーション	45,700	569.00	26,003,300	
中越パルプ工業	4,300	1,646.00	7,077,800	
大王製紙	29,400	1,494.00	43,923,600	
レンゴー	65,300	826.00	53,937,800	
トーモク	5,100	1,780.00	9,078,000	
ザ・パック	5,000	3,910.00	19,550,000	
クラレ	108,000	1,348.00	145,584,000	
旭化成	459,400	1,224.50	562,535,300	
昭和電工	48,700	2,965.00	144,395,500	
住友化学	507,300	503.00	255,171,900	
住友精化	3,300	3,490.00	11,517,000	
日産化学	38,500	4,440.00	170,940,000	
ラサ工業	3,300	1,524.00	5,029,200	
クレハ	5,800	6,550.00	37,990,000	
多木化学	2,300	4,550.00	10,465,000	
テイカ	5,200	1,954.00	10,160,800	
石原産業	12,900	1,184.00	15,273,600	
日本曹達	10,200	2,956.00	30,151,200	

東ソー	105,200	1,659.00	174,526,800	
トクヤマ	19,900	2,976.00	59,222,400	
セントラル硝子	14,500	2,697.00	39,106,500	
東亞合成	43,600	1,275.00	55,590,000	
大阪ソーダ	6,900	3,050.00	21,045,000	
関東電化工業	16,800	1,053.00	17,690,400	
デンカ	24,900	3,295.00	82,045,500	
信越化学工業	118,400	11,905.00	1,409,552,000	
日本カーバイド工業	3,200	1,487.00	4,758,400	
堺化学工業	4,600	2,514.00	11,564,400	
第一稀元素化学工業	9,400	873.00	8,206,200	
エア・ウォーター	55,700	1,752.00	97,586,400	
大陽日酸	66,200	2,450.00	162,190,000	
日本化学工業	2,400	3,190.00	7,656,000	
日本パーカライジング	35,400	1,167.00	41,311,800	
高圧ガス工業	12,400	803.00	9,957,200	
チタン工業	1,800	2,678.00	4,820,400	
四国化成工業	10,400	1,294.00	13,457,600	
戸田工業	2,500	2,214.00	5,535,000	
ステラ　ケミファ	4,000	3,235.00	12,940,000	
保土谷化学工業	2,800	3,900.00	10,920,000	
日本触媒	10,800	6,870.00	74,196,000	
大日精化工業	6,200	3,230.00	20,026,000	
カネカ	17,700	3,565.00	63,100,500	
三菱瓦斯化学	64,500	1,724.00	111,198,000	
三井化学	62,600	2,650.00	165,890,000	
ＪＳＲ	64,300	1,930.00	124,099,000	
東京応化工業	12,000	4,075.00	48,900,000	
大阪有機化学工業	7,200	1,399.00	10,072,800	
三菱ケミカルホールディングス	461,000	818.50	377,328,500	
ＫＨネオケム	12,300	2,514.00	30,922,200	
ダイセル	94,000	1,090.00	102,460,000	
住友ベークライト	10,900	4,350.00	47,415,000	
積水化学工業	148,200	1,920.00	284,544,000	
日本ゼオン	62,300	1,405.00	87,531,500	
アイカ工業	20,700	3,520.00	72,864,000	
宇部興産	34,200	2,404.00	82,216,800	
積水樹脂	12,300	2,286.00	28,117,800	
タキロンシーアイ	16,100	676.00	10,883,600	
旭有機材	4,500	1,720.00	7,740,000	
日立化成	31,900	4,015.00	128,078,500	
ニチバン	4,100	1,946.00	7,978,600	

リケンテクノス	19,200	510.00	9,792,000	
大倉工業	3,900	1,945.00	7,585,500	
積水化成品工業	10,200	800.00	8,160,000	
群栄化学工業	2,400	2,499.00	5,997,600	
ミライアル	3,300	1,377.00	4,544,100	
ダイキョーニシカワ	14,400	864.00	12,441,600	
森六ホールディングス	4,100	2,379.00	9,753,900	
日本化薬	43,100	1,388.00	59,822,800	
カーリットホールディングス	9,500	630.00	5,985,000	
日本精化	6,700	1,248.00	8,361,600	
扶桑化学工業	6,900	3,075.00	21,217,500	
トリケミカル研究所	1,600	7,800.00	12,480,000	
ＡＤＥＫＡ	31,900	1,670.00	53,273,000	
日油	25,900	3,730.00	96,607,000	
ハリマ化成グループ	6,200	1,244.00	7,712,800	
花王	168,500	8,708.00	1,467,298,000	
第一工業製薬	2,900	3,725.00	10,802,500	
三洋化成工業	4,000	5,490.00	21,960,000	
大日本塗料	9,100	1,166.00	10,610,600	
日本ペイントホールディングス	56,800	5,880.00	333,984,000	
関西ペイント	77,600	2,797.00	217,047,200	
中国塗料	20,300	1,034.00	20,990,200	
日本特殊塗料	5,900	1,376.00	8,118,400	
藤倉化成	13,200	572.00	7,550,400	
太陽ホールディングス	5,000	4,175.00	20,875,000	
ＤＩＣ	28,700	2,998.00	86,042,600	
サカタインクス	15,100	1,197.00	18,074,700	
東洋インキＳＣホールディングス	13,900	2,681.00	37,265,900	
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	7,100	1,002.00	7,114,200	
富士フイルムホールディングス	134,800	5,182.00	698,533,600	
資生堂	139,800	8,019.00	1,121,056,200	
ライオン	91,300	2,204.00	201,225,200	
高砂香料工業	4,600	2,582.00	11,877,200	
マンダム	15,800	3,035.00	47,953,000	
ミルボン	9,400	6,310.00	59,314,000	
ファンケル	28,600	2,934.00	83,912,400	
コーセー	13,200	17,630.00	232,716,000	
コタ	5,100	1,387.00	7,073,700	
ポーラ・オルビスホールディングス	30,000	2,722.00	81,660,000	
ノエビアホールディングス	6,600	6,280.00	41,448,000	
エステー	5,400	1,736.00	9,374,400	
アグロ　カネショウ	3,300	1,435.00	4,735,500	

コニシ	11,800	1,487.00	17,546,600	
長谷川香料	9,700	1,982.00	19,225,400	
小林製薬	19,700	9,040.00	178,088,000	
荒川化学工業	7,000	1,581.00	11,067,000	
メック	5,400	1,625.00	8,775,000	
タカラバイオ	18,700	2,154.00	40,279,800	
ＪＣＵ	8,700	2,952.00	25,682,400	
デクセリアルズ	19,000	1,095.00	20,805,000	
アース製薬	5,300	5,700.00	30,210,000	
北興化学工業	9,100	588.00	5,350,800	
大成ラミック	3,300	2,850.00	9,405,000	
クミアイ化学工業	29,500	1,027.00	30,296,500	
日本農薬	14,600	588.00	8,584,800	
アキレス	5,600	1,826.00	10,225,600	
有沢製作所	11,700	998.00	11,676,600	
日東電工	48,200	6,210.00	299,322,000	
レック	8,100	1,300.00	10,530,000	
三光合成	11,600	432.00	5,011,200	
藤森工業	6,100	3,530.00	21,533,000	
前澤化成工業	6,600	1,197.00	7,900,200	
未来工業	4,500	2,243.00	10,093,500	
ＪＳＰ	4,600	1,905.00	8,763,000	
エフピコ	7,800	6,650.00	51,870,000	
天馬	5,300	2,012.00	10,663,600	
信越ポリマー	12,600	968.00	12,196,800	
東リ	23,100	316.00	7,299,600	
ニフコ	25,500	3,050.00	77,775,000	
バルカー	5,900	2,624.00	15,481,600	
ユニ・チャーム	136,100	3,634.00	494,587,400	
協和キリン	70,200	2,341.00	164,338,200	
武田薬品工業	586,000	4,491.00	2,631,726,000	
アステラス製薬	619,500	1,898.00	1,175,811,000	
大日本住友製薬	52,500	2,123.00	111,457,500	
塩野義製薬	89,900	6,517.00	585,878,300	
田辺三菱製薬	85,200	2,003.00	170,655,600	
あすか製薬	9,000	1,322.00	11,898,000	
日本新薬	18,400	9,960.00	183,264,000	
中外製薬	73,400	9,813.00	720,274,200	
科研製薬	12,200	5,970.00	72,834,000	
エーザイ	84,300	8,072.00	680,469,600	
ロート製薬	35,900	3,505.00	125,829,500	
小野薬品工業	162,000	2,457.50	398,115,000	

久光製薬	20,700	5,410.00	111,987,000	
持田製薬	10,000	4,475.00	44,750,000	
参天製薬	130,900	2,064.00	270,177,600	
扶桑薬品工業	3,600	2,103.00	7,570,800	
日本ケミファ	1,500	2,972.00	4,458,000	
ツムラ	22,100	3,195.00	70,609,500	
日医工	20,100	1,350.00	27,135,000	
キッセイ薬品工業	12,800	3,050.00	39,040,000	
生化学工業	14,200	1,271.00	18,048,200	
栄研化学	12,800	1,988.00	25,446,400	
鳥居薬品	4,500	2,851.00	12,829,500	
ＪＣＲファーマ	5,000	9,350.00	46,750,000	
東和薬品	9,000	2,839.00	25,551,000	
富士製薬工業	5,600	1,410.00	7,896,000	
沢井製薬	14,700	6,530.00	95,991,000	
ゼリア新薬工業	13,000	2,178.00	28,314,000	
第一三共	201,400	7,012.00	1,412,216,800	
キョーリン製薬ホールディングス	14,700	1,879.00	27,621,300	
大幸薬品	3,300	3,370.00	11,121,000	
ダイト	4,400	3,175.00	13,970,000	
大塚ホールディングス	134,100	4,839.00	648,909,900	
大正製薬ホールディングス	14,800	8,180.00	121,064,000	
ペプチドリーム	35,700	5,110.00	182,427,000	
日本コークス工業	81,700	81.00	6,617,700	
ニチレキ	9,500	1,300.00	12,350,000	
ユシロ化学工業	5,900	1,375.00	8,112,500	
富士石油	25,200	238.00	5,997,600	
出光興産	79,100	2,966.00	234,610,600	
ＪＸＴＧホールディングス	1,090,700	487.60	531,825,320	
コスモエネルギーホールディングス	20,700	2,394.00	49,555,800	
横浜ゴム	40,700	2,303.00	93,732,100	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	41,200	1,580.00	65,096,000	
ブリヂストン	216,700	4,421.00	958,030,700	
住友ゴム工業	63,400	1,412.00	89,520,800	
オカモト	4,500	4,180.00	18,810,000	
ニッタ	7,900	3,195.00	25,240,500	
住友理工	13,700	1,023.00	14,015,100	
三ツ星ベルト	9,600	2,111.00	20,265,600	
バンドー化学	13,500	926.00	12,501,000	
日東紡績	10,600	4,100.00	43,460,000	
ＡＧＣ	69,500	4,075.00	283,212,500	
日本板硝子	21,500	649.00	13,953,500	

日本山村硝子	5,400	1,283.00	6,928,200	
日本電気硝子	28,500	2,380.00	67,830,000	
オハラ	3,600	1,461.00	5,259,600	
住友大阪セメント	13,700	4,690.00	64,253,000	
太平洋セメント	44,500	3,240.00	144,180,000	
日本ヒューム	9,300	821.00	7,635,300	
日本コンクリート工業	20,500	272.00	5,576,000	
三谷セキサン	3,500	3,590.00	12,565,000	
アジアパイルホールディングス	13,300	550.00	7,315,000	
東海カーボン	73,800	1,089.00	80,368,200	
日本カーボン	3,700	4,285.00	15,854,500	
東洋炭素	4,600	2,427.00	11,164,200	
ノリタケカンパニーリミテド	4,000	4,760.00	19,040,000	
ＴＯＴＯ	50,300	4,785.00	240,685,500	
日本碍子	85,400	1,857.00	158,587,800	
日本特殊陶業	54,600	2,228.00	121,648,800	
ＭＡＲＵＷＡ	2,800	7,550.00	21,140,000	
品川リフラクトリーズ	2,400	3,220.00	7,728,000	
黒崎播磨	1,500	5,820.00	8,730,000	
ヨータイ	8,200	694.00	5,690,800	
東京窯業	16,500	341.00	5,626,500	
フジミインコーポレーテッド	6,400	2,889.00	18,489,600	
ニチアス	19,300	2,611.00	50,392,300	
ニチハ	9,700	2,777.00	26,936,900	
日本製鉄	311,500	1,628.50	507,277,750	
神戸製鋼所	129,300	569.00	73,571,700	
中山製鋼所	13,000	497.00	6,461,000	
合同製鐵	4,100	2,634.00	10,799,400	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	187,900	1,412.00	265,314,800	
東京製鐵	34,200	836.00	28,591,200	
共英製鋼	8,000	2,100.00	16,800,000	
大和工業	15,100	2,755.00	41,600,500	
東京鐵鋼	4,000	1,532.00	6,128,000	
大阪製鐵	4,500	1,449.00	6,520,500	
淀川製鋼所	9,100	2,129.00	19,373,900	
丸一鋼管	22,900	3,180.00	72,822,000	
モリ工業	2,700	2,504.00	6,760,800	
大同特殊鋼	11,400	4,965.00	56,601,000	
日本冶金工業	5,900	2,330.00	13,747,000	
山陽特殊製鋼	5,400	1,497.00	8,083,800	
愛知製鋼	3,900	3,640.00	14,196,000	
日立金属	74,900	1,537.00	115,121,300	

大平洋金属	4,900	2,418.00	11,848,200	
新日本電工	50,200	181.00	9,086,200	
栗本鐵工所	4,300	1,981.00	8,518,300	
三菱製鋼	6,700	1,140.00	7,638,000	
シンニッタン	14,700	446.00	6,556,200	
大紀アルミニウム工業所	11,200	783.00	8,769,600	
日本軽金属ホールディングス	178,000	227.00	40,406,000	
三井金属鉱業	18,900	2,761.00	52,182,900	
東邦亜鉛	4,000	2,135.00	8,540,000	
三菱マテリアル	45,700	2,952.00	134,906,400	
住友金属鉱山	89,200	3,301.00	294,449,200	
ＤＯＷＡホールディングス	17,600	3,950.00	69,520,000	
古河機械金属	12,500	1,516.00	18,950,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	7,800	1,573.00	12,269,400	
東邦チタニウム	13,700	970.00	13,289,000	
ＵＡＣＪ	10,700	2,487.00	26,610,900	
ＣＫサンエツ	1,800	3,005.00	5,409,000	
古河電気工業	21,500	3,030.00	65,145,000	
住友電気工業	260,000	1,674.50	435,370,000	
フジクラ	85,900	459.00	39,428,100	
昭和電線ホールディングス	9,600	1,015.00	9,744,000	
タツタ電線	15,300	587.00	8,981,100	
リョービ	8,500	2,103.00	17,875,500	
アーレスティ	11,500	534.00	6,141,000	
アサヒホールディングス	12,500	2,607.00	32,587,500	
稲葉製作所	5,500	1,431.00	7,870,500	
宮地エンジニアリンググループ	3,300	2,085.00	6,880,500	
トーカロ	19,400	1,112.00	21,572,800	
アルファＣｏ	4,300	1,311.00	5,637,300	
ＳＵＭＣＯ	83,500	1,691.00	141,198,500	
川田テクノロジーズ	1,700	6,850.00	11,645,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	2,200	3,715.00	8,173,000	
東洋製罐グループホールディングス	44,600	1,942.00	86,613,200	
ホッカンホールディングス	4,800	1,960.00	9,408,000	
コロナ	5,900	1,190.00	7,021,000	
横河ブリッジホールディングス	13,000	1,891.00	24,583,000	
三和ホールディングス	66,800	1,220.00	81,496,000	
文化シヤッター	21,200	971.00	20,585,200	
三協立山	10,500	1,248.00	13,104,000	
アルインコ	7,000	1,197.00	8,379,000	
ＬＩＸＩＬグループ	103,000	1,885.00	194,155,000	
ノーリツ	14,900	1,408.00	20,979,200	

長府製作所	7,200	2,461.00	17,719,200	
リンナイ	13,600	8,430.00	114,648,000	
日東精工	13,000	654.00	8,502,000	
岡部	14,600	926.00	13,519,600	
ジーテクト	8,700	1,736.00	15,103,200	
東プレ	12,900	1,729.00	22,304,100	
高周波熱錬	14,200	887.00	12,595,400	
東京製綱	6,700	1,156.00	7,745,200	
パイオラックス	10,200	2,216.00	22,603,200	
エイチワン	9,300	845.00	7,858,500	
日本発條	75,000	982.00	73,650,000	
三益半導体工業	6,200	2,012.00	12,474,400	
日本製鋼所	21,500	2,265.00	48,697,500	
三浦工業	30,100	3,695.00	111,219,500	
タクマ	23,700	1,278.00	30,288,600	
ツガミ	14,800	1,131.00	16,738,800	
オークマ	8,000	6,150.00	49,200,000	
東芝機械	7,900	2,801.00	22,127,900	
アマダホールディングス	87,300	1,247.00	108,863,100	
アイダエンジニアリング	18,200	1,002.00	18,236,400	
ＦＵＪＩ	28,700	1,947.00	55,878,900	
牧野フライス製作所	8,000	5,410.00	43,280,000	
オーエスジー	32,400	2,257.00	73,126,800	
旭ダイヤモンド工業	19,100	656.00	12,529,600	
DMG森精機	43,900	1,753.00	76,956,700	
ソディック	16,700	1,022.00	17,067,400	
ディスコ	9,400	23,550.00	221,370,000	
日東工器	4,300	2,227.00	9,576,100	
日進工具	2,100	2,325.00	4,882,500	
パンチ工業	9,200	574.00	5,280,800	
豊和工業	5,700	748.00	4,263,600	
島精機製作所	11,300	2,779.00	31,402,700	
オプトラン	8,000	2,933.00	23,464,000	
イワキポンプ	4,500	1,146.00	5,157,000	
フリュー	8,600	1,050.00	9,030,000	
ヤマシンフィルタ	15,200	876.00	13,315,200	
日阪製作所	10,300	1,000.00	10,300,000	
やまびこ	13,800	1,141.00	15,745,800	
平田機工	3,300	7,970.00	26,301,000	
ペガサスミシン製造	10,700	513.00	5,489,100	
マルマエ	3,500	1,043.00	3,650,500	
タツモ	3,600	1,198.00	4,312,800	

ナブテスコ	40,900	3,410.00	139,469,000	
三井海洋開発	7,600	2,497.00	18,977,200	
レオン自動機	6,900	1,657.00	11,433,300	
ＳＭＣ	22,100	49,930.00	1,103,453,000	
ホソカワミクロン	2,700	4,515.00	12,190,500	
ユニオンツール	2,600	3,290.00	8,554,000	
オイレス工業	9,300	1,692.00	15,735,600	
日精エー・エス・ビー機械	2,600	4,895.00	12,727,000	
サトーホールディングス	10,100	3,370.00	34,037,000	
技研製作所	6,400	4,440.00	28,416,000	
日精樹脂工業	7,300	1,026.00	7,489,800	
ワイエイシイホールディングス	4,100	715.00	2,931,500	
小松製作所	318,700	2,587.00	824,476,900	
住友重機械工業	39,800	3,165.00	125,967,000	
日立建機	27,500	2,951.00	81,152,500	
日工	12,400	751.00	9,312,400	
巴工業	3,900	2,282.00	8,899,800	
井関農機	7,900	1,657.00	13,090,300	
ＴＯＷＡ	7,800	1,150.00	8,970,000	
北川鉄工所	3,600	2,268.00	8,164,800	
ローツェ	3,200	3,925.00	12,560,000	
クボタ	373,200	1,725.50	643,956,600	
荏原実業	2,600	2,266.00	5,891,600	
三菱化工機	3,700	1,906.00	7,052,200	
月島機械	13,400	1,706.00	22,860,400	
帝国電機製作所	7,100	1,322.00	9,386,200	
新東工業	16,700	1,038.00	17,334,600	
澁谷工業	6,300	3,160.00	19,908,000	
アイチ　コーポレーション	13,700	723.00	9,905,100	
小森コーポレーション	17,600	1,161.00	20,433,600	
鶴見製作所	6,100	2,056.00	12,541,600	
住友精密工業	1,800	3,450.00	6,210,000	
酒井重工業	1,900	3,065.00	5,823,500	
荏原製作所	29,300	3,345.00	98,008,500	
西島製作所	8,900	962.00	8,561,800	
北越工業	8,500	1,278.00	10,863,000	
ダイキン工業	89,700	15,770.00	1,414,569,000	
オルガノ	2,600	6,540.00	17,004,000	
トーヨーカネツ	3,900	2,284.00	8,907,600	
栗田工業	37,800	3,135.00	118,503,000	
椿本チエイン	9,600	3,820.00	36,672,000	
大同工業	6,200	837.00	5,189,400	

アネスト岩田	11,900	1,016.00	12,090,400	
ダイフク	35,600	6,590.00	234,604,000	
加藤製作所	4,500	1,841.00	8,284,500	
タダノ	34,800	1,091.00	37,966,800	
フジテック	25,100	1,745.00	43,799,500	
ＣＫＤ	19,700	1,855.00	36,543,500	
キトー	6,000	1,651.00	9,906,000	
平和	19,700	2,269.00	44,699,300	
理想科学工業	6,600	1,893.00	12,493,800	
ＳＡＮＫＹＯ	16,100	3,720.00	59,892,000	
日本金銭機械	9,400	929.00	8,732,600	
マースグループホールディングス	5,500	2,036.00	11,198,000	
福島工業	4,400	3,500.00	15,400,000	
ダイコク電機	4,500	1,682.00	7,569,000	
竹内製作所	11,600	1,692.00	19,627,200	
アマノ	18,500	3,285.00	60,772,500	
ＪＵＫＩ	10,600	914.00	9,688,400	
マックス	10,700	2,106.00	22,534,200	
グローリー	19,700	3,330.00	65,601,000	
新晃工業	6,900	1,891.00	13,047,900	
大和冷機工業	10,700	1,292.00	13,824,400	
セガサミーホールディングス	70,400	1,585.00	111,584,000	
日本ピストンリング	4,400	1,441.00	6,340,400	
リケン	3,400	4,295.00	14,603,000	
ＴＰＲ	9,000	2,091.00	18,819,000	
ツバキ・ナカシマ	14,600	1,716.00	25,053,600	
ホシザキ	20,600	9,610.00	197,966,000	
大豊工業	7,400	874.00	6,467,600	
日本精工	130,700	1,077.00	140,763,900	
ＮＴＮ	161,900	346.00	56,017,400	
ジェイテクト	65,900	1,384.00	91,205,600	
不二越	6,600	5,140.00	33,924,000	
日本トムソン	22,900	499.00	11,427,100	
ＴＨＫ	40,800	3,120.00	127,296,000	
ユーシン精機	6,700	1,059.00	7,095,300	
前澤給装工業	3,700	2,147.00	7,943,900	
イーグル工業	8,900	1,086.00	9,665,400	
日本ピラー工業	7,800	1,512.00	11,793,600	
キッツ	29,000	762.00	22,098,000	
マキタ	91,500	3,705.00	339,007,500	
日立造船	56,000	435.00	24,360,000	
三菱重工業	117,700	4,244.00	499,518,800	

ＩＨＩ	50,900	2,584.00	131,525,600	
スター精密	11,200	1,549.00	17,348,800	
日清紡ホールディングス	47,800	1,019.00	48,708,200	
イビデン	43,500	2,579.00	112,186,500	
コニカミノルタ	155,100	726.00	112,602,600	
ブラザー工業	85,500	2,201.00	188,185,500	
ミネベアミツミ	130,100	2,159.00	280,885,900	
日立製作所	338,300	4,309.00	1,457,734,700	
三菱電機	704,000	1,534.50	1,080,288,000	
富士電機	42,200	3,425.00	144,535,000	
東洋電機製造	3,800	1,565.00	5,947,000	
安川電機	75,600	4,065.00	307,314,000	
シンフォニアテクノロジー	9,400	1,377.00	12,943,800	
明電舎	13,100	2,148.00	28,138,800	
オリジン	3,400	1,517.00	5,157,800	
山洋電気	3,500	5,460.00	19,110,000	
デンヨー	6,500	2,090.00	13,585,000	
東芝テック	8,800	4,460.00	39,248,000	
芝浦メカトロニクス	1,600	3,970.00	6,352,000	
マブチモーター	19,300	4,225.00	81,542,500	
日本電産	84,700	16,325.00	1,382,727,500	
トレックス・セミコンダクター	4,900	1,469.00	7,198,100	
東光高岳	5,500	1,197.00	6,583,500	
宮越ホールディングス	3,900	1,028.00	4,009,200	
ダイヘン	7,700	3,695.00	28,451,500	
ヤーマン	11,200	702.00	7,862,400	
ＪＶＣケンウッド	60,000	275.00	16,500,000	
ミマキエンジニアリング	9,300	528.00	4,910,400	
第一精工	3,000	2,645.00	7,935,000	
日新電機	16,700	1,152.00	19,238,400	
大崎電気工業	16,200	745.00	12,069,000	
オムロン	65,300	6,540.00	427,062,000	
日東工業	10,700	2,504.00	26,792,800	
ＩＤＥＣ	10,500	2,365.00	24,832,500	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	24,100	2,304.00	55,526,400	
サクサホールディングス	3,000	1,978.00	5,934,000	
メルコホールディングス	2,800	3,100.00	8,680,000	
日本電気	85,400	4,440.00	379,176,000	
富士通	67,900	10,050.00	682,395,000	
沖電気工業	29,900	1,530.00	45,747,000	
電気興業	3,700	3,115.00	11,525,500	
サンケン電気	8,000	3,170.00	25,360,000	

アイホン	5,100	1,906.00	9,720,600	
ルネサスエレクトロニクス	336,300	719.00	241,799,700	
セイコーエプソン	86,900	1,662.00	144,427,800	
ワコム	47,800	448.00	21,414,400	
アルバック	14,100	4,300.00	60,630,000	
ＥＩＺＯ	5,500	4,180.00	22,990,000	
日本信号	18,500	1,304.00	24,124,000	
京三製作所	19,000	516.00	9,804,000	
能美防災	9,600	2,383.00	22,876,800	
ホーチキ	6,000	1,667.00	10,002,000	
エレコム	7,700	4,145.00	31,916,500	
パナソニック	805,200	1,032.00	830,966,400	
シャープ	81,600	1,656.00	135,129,600	
アンリツ	45,700	2,072.00	94,690,400	
富士通ゼネラル	19,800	2,107.00	41,718,600	
ソニー	444,900	6,998.00	3,113,410,200	
ＴＤＫ	33,800	11,690.00	395,122,000	
帝国通信工業	5,800	1,205.00	6,989,000	
タムラ製作所	24,200	660.00	15,972,000	
アルプスアルパイン	62,200	2,487.00	154,691,400	
日本トリム	1,300	4,960.00	6,448,000	
ローランド　ディー．ジー．	4,800	2,175.00	10,440,000	
フォスター電機	7,700	2,023.00	15,577,100	
ＳＭＫ	2,400	2,979.00	7,149,600	
ヨコオ	4,600	3,255.00	14,973,000	
ホシデン	19,300	1,318.00	25,437,400	
ヒロセ電機	10,900	13,710.00	149,439,000	
日本航空電子工業	16,000	2,104.00	33,664,000	
ＴＯＡ	8,900	1,100.00	9,790,000	
マクセルホールディングス	15,400	1,494.00	23,007,600	
古野電気	10,100	1,263.00	12,756,300	
ユニデンホールディングス	2,800	1,837.00	5,143,600	
スミダコーポレーション	6,400	1,325.00	8,480,000	
アイコム	4,600	2,588.00	11,904,800	
リオン	3,500	2,964.00	10,374,000	
船井電機	9,500	740.00	7,030,000	
横河電機	64,700	2,014.00	130,305,800	
新電元工業	2,800	3,685.00	10,318,000	
アズビル	44,100	3,185.00	140,458,500	
東亜ディーケーケー	5,500	860.00	4,730,000	
日本光電工業	29,600	2,969.00	87,882,400	
チノー	4,200	1,422.00	5,972,400	

共和電業	15,200	443.00	6,733,600	
堀場製作所	14,000	7,350.00	102,900,000	
アドバンテスト	52,400	5,320.00	278,768,000	
エスペック	6,500	2,132.00	13,858,000	
キーエンス	63,800	37,970.00	2,422,486,000	
日置電機	3,900	3,740.00	14,586,000	
シスメックス	50,500	7,761.00	391,930,500	
日本マイクロニクス	11,500	1,154.00	13,271,000	
メガチップス	7,000	2,462.00	17,234,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	3,800	3,885.00	14,763,000	
コーセル	9,900	1,251.00	12,384,900	
イリソ電子工業	6,000	5,300.00	31,800,000	
オプテックスグループ	11,900	1,622.00	19,301,800	
千代田インテグレ	3,800	2,395.00	9,101,000	
レーザーテック	14,400	9,580.00	137,952,000	
スタンレー電気	49,300	3,105.00	153,076,500	
岩崎電気	4,600	1,425.00	6,555,000	
ウシオ電機	41,400	1,643.00	68,020,200	
ヘリオス　テクノ　ホールディング	9,200	500.00	4,600,000	
日本セラミック	7,400	2,861.00	21,171,400	
山一電機	5,700	1,595.00	9,091,500	
図研	5,100	2,510.00	12,801,000	
日本電子	14,000	3,090.00	43,260,000	
カシオ計算機	62,600	2,080.00	130,208,000	
ファナック	66,900	21,240.00	1,420,956,000	
日本シイエムケイ	17,800	658.00	11,712,400	
エンプラス	3,600	3,650.00	13,140,000	
ローム	31,200	9,170.00	286,104,000	
浜松ホトニクス	50,400	4,455.00	224,532,000	
三井ハイテック	8,000	2,051.00	16,408,000	
新光電気工業	23,600	1,096.00	25,865,600	
京セラ	99,100	7,445.00	737,799,500	
太陽誘電	31,300	2,975.00	93,117,500	
村田製作所	206,800	6,529.00	1,350,197,200	
双葉電子工業	11,500	1,389.00	15,973,500	
北陸電気工業	4,200	1,124.00	4,720,800	
ニチコン	24,200	1,235.00	29,887,000	
日本ケミコン	5,900	2,081.00	12,277,900	
ＫＯＡ	11,000	1,440.00	15,840,000	
市光工業	11,200	868.00	9,721,600	
小糸製作所	42,100	5,700.00	239,970,000	
ミツバ	14,000	741.00	10,374,000	

ＳＣＲＥＥＮホールディングス	12,300	7,600.00	93,480,000	
キヤノン電子	7,500	2,075.00	15,562,500	
キヤノン	378,800	3,046.00	1,153,824,800	
リコー	179,100	1,124.00	201,308,400	
象印マホービン	21,100	1,798.00	37,937,800	
東京エレクトロン	46,900	22,570.00	1,058,533,000	
トヨタ紡織	20,200	1,726.00	34,865,200	
ユニプレス	13,800	1,688.00	23,294,400	
豊田自動織機	56,900	6,470.00	368,143,000	
モリタホールディングス	12,500	1,756.00	21,950,000	
三櫻工業	8,500	1,340.00	11,390,000	
デンソー	155,000	4,953.00	767,715,000	
東海理化電機製作所	18,400	2,163.00	39,799,200	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	14,900	922.00	13,737,800	
川崎重工業	54,700	2,481.00	135,710,700	
名村造船所	27,400	287.00	7,863,800	
日本車輌製造	3,300	3,175.00	10,477,500	
三菱ロジスネクスト	9,200	1,226.00	11,279,200	
日産自動車	830,600	688.30	571,701,980	
いすゞ自動車	204,900	1,290.50	264,423,450	
トヨタ自動車	784,800	7,738.00	6,072,782,400	代用有価証券 400,000株
日野自動車	87,700	1,102.00	96,645,400	
三菱自動車工業	261,100	496.00	129,505,600	
エフテック	7,600	755.00	5,738,000	
武蔵精密工業	15,900	1,523.00	24,215,700	
日産車体	14,200	1,138.00	16,159,600	
新明和工業	19,200	1,460.00	28,032,000	
極東開発工業	12,700	1,631.00	20,713,700	
日信工業	14,300	2,224.00	31,803,200	
トピー工業	6,000	2,084.00	12,504,000	
ティラド	3,500	2,035.00	7,122,500	
タチエス	12,000	1,442.00	17,304,000	
ＮＯＫ	38,100	1,729.00	65,874,900	
フタバ産業	20,100	826.00	16,602,600	
ＫＹＢ	8,000	3,315.00	26,520,000	
大同メタル工業	16,800	728.00	12,230,400	
プレス工業	35,700	444.00	15,850,800	
太平洋工業	15,000	1,513.00	22,695,000	
ケーヒン	16,000	2,572.00	41,152,000	
河西工業	11,000	873.00	9,603,000	
アイシン精機	57,700	4,245.00	244,936,500	
マツダ	206,800	977.00	202,043,600	

今仙電機製作所	9,500	941.00	8,939,500	
本田技研工業	554,300	3,104.00	1,720,547,200	
スズキ	139,700	4,755.00	664,273,500	
ＳＵＢＡＲＵ	218,900	2,873.50	629,009,150	
安永	4,100	1,293.00	5,301,300	
ヤマハ発動機	92,000	2,307.00	212,244,000	
ショーワ	16,600	2,277.00	37,798,200	
ＴＢＫ	15,300	431.00	6,594,300	
エクセディ	9,400	2,508.00	23,575,200	
豊田合成	22,700	2,604.00	59,110,800	
愛三工業	12,300	866.00	10,651,800	
日本プラスト	8,400	718.00	6,031,200	
ヨロズ	7,700	1,446.00	11,134,200	
エフ・シー・シー	11,300	2,412.00	27,255,600	
シマノ	26,300	17,920.00	471,296,000	
テイ・エス　テック	16,400	3,415.00	56,006,000	
ジャムコ	4,800	1,510.00	7,248,000	
テルモ	199,300	3,910.00	779,263,000	
日機装	21,600	1,348.00	29,116,800	
日本エム・ディ・エム	4,600	2,327.00	10,704,200	
島津製作所	84,300	3,315.00	279,454,500	
ＪＭＳ	9,600	743.00	7,132,800	
長野計器	7,800	783.00	6,107,400	
ブイ・テクノロジー	3,300	6,010.00	19,833,000	
東京計器	6,400	1,015.00	6,496,000	
インターアクション	4,200	2,502.00	10,508,400	
東京精密	12,800	3,935.00	50,368,000	
マニー	28,300	2,935.00	83,060,500	
ニコン	113,600	1,506.00	171,081,600	
トプコン	36,100	1,471.00	53,103,100	
オリンパス	390,000	1,634.00	637,260,000	
理研計器	6,100	2,325.00	14,182,500	
タムロン	5,900	2,529.00	14,921,100	
ＨＯＹＡ	141,800	10,025.00	1,421,545,000	
ノーリツ鋼機	5,200	1,896.00	9,859,200	
エー・アンド・デイ	7,900	803.00	6,343,700	
朝日インテック	59,700	3,195.00	190,741,500	
シチズン時計	82,700	610.00	50,447,000	
メニコン	9,600	4,350.00	41,760,000	
松風	4,300	1,700.00	7,310,000	
セイコーホールディングス	9,800	2,816.00	27,596,800	
ニプロ	49,900	1,327.00	66,217,300	

スノーピーク	4,500	1,096.00	4,932,000	
パラマウントベッドホールディングス	7,300	4,310.00	31,463,000	
トランザクション	5,300	1,000.00	5,300,000	
ニホンフラッシュ	3,700	2,819.00	10,430,300	
前田工繊	8,100	1,950.00	15,795,000	
永大産業	14,700	341.00	5,012,700	
アートネイチャー	8,200	773.00	6,338,600	
バンダイナムコホールディングス	73,000	6,688.00	488,224,000	
ＳＨＯＥＩ	3,400	5,060.00	17,204,000	
フランスベッドホールディングス	11,800	1,022.00	12,059,600	
パイロットコーポレーション	12,500	4,270.00	53,375,000	
萩原工業	4,400	1,617.00	7,114,800	
トッパン・フォームズ	14,900	1,162.00	17,313,800	
フジシールインターナショナル	15,900	2,487.00	39,543,300	
タカラトミー	31,800	1,345.00	42,771,000	
廣済堂	7,600	880.00	6,688,000	
プロネクサス	7,200	1,206.00	8,683,200	
大建工業	5,000	1,974.00	9,870,000	
凸版印刷	99,200	2,178.00	216,057,600	
大日本印刷	91,700	2,940.00	269,598,000	
共同印刷	2,000	2,950.00	5,900,000	
ＮＩＳＳＨＡ	14,800	1,133.00	16,768,400	
ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	3,700	1,702.00	6,297,400	
アシックス	58,900	1,786.00	105,195,400	
小松ウオール工業	2,600	2,408.00	6,260,800	
ヤマハ	41,700	6,130.00	255,621,000	
河合楽器製作所	2,500	3,675.00	9,187,500	
クリナップ	9,000	705.00	6,345,000	
ピジョン	42,600	5,070.00	215,982,000	
キングジム	6,800	892.00	6,065,600	
リンテック	17,000	2,463.00	41,871,000	
イトーキ	18,500	517.00	9,564,500	
任天堂	43,200	43,240.00	1,867,968,000	
三菱鉛筆	11,500	1,737.00	19,975,500	
タカラスタンダード	14,100	2,007.00	28,298,700	
コクヨ	34,000	1,635.00	55,590,000	
ナカバヤシ	7,400	594.00	4,395,600	
グローブライド	3,600	2,703.00	9,730,800	
オカムラ	24,300	1,080.00	26,244,000	
美津濃	6,500	2,805.00	18,232,500	
東京電力ホールディングス	558,300	483.00	269,658,900	
中部電力	215,400	1,535.50	330,746,700	

関西電力	267,200	1,251.00	334,267,200	
中国電力	96,800	1,456.00	140,940,800	
北陸電力	66,000	790.00	52,140,000	
東北電力	176,000	1,105.00	194,480,000	
四国電力	63,800	1,059.00	67,564,200	
九州電力	143,700	971.00	139,532,700	
北海道電力	68,100	532.00	36,229,200	
沖縄電力	13,000	2,003.00	26,039,000	
電源開発	55,700	2,678.00	149,164,600	
イーレックス	10,400	1,747.00	18,168,800	
レノバ	11,500	1,160.00	13,340,000	
東京瓦斯	136,000	2,653.00	360,808,000	
大阪瓦斯	136,700	2,077.00	283,925,900	
東邦瓦斯	34,900	4,170.00	145,533,000	
北海道瓦斯	4,600	1,586.00	7,295,600	
広島ガス	17,000	359.00	6,103,000	
西部瓦斯	7,800	2,520.00	19,656,000	
静岡ガス	20,400	928.00	18,931,200	
メタウォーター	3,200	4,070.00	13,024,000	
ＳＢＳホールディングス	6,600	1,967.00	12,982,200	
東武鉄道	73,900	4,055.00	299,664,500	
相鉄ホールディングス	22,800	3,040.00	69,312,000	
東急	177,400	2,177.00	386,199,800	
京浜急行電鉄	90,400	2,242.00	202,676,800	
小田急電鉄	104,000	2,708.00	281,632,000	
京王電鉄	36,500	7,060.00	257,690,000	
京成電鉄	48,800	4,535.00	221,308,000	
富士急行	9,800	4,265.00	41,797,000	
新京成電鉄	2,800	2,303.00	6,448,400	
東日本旅客鉄道	124,000	10,085.00	1,250,540,000	
西日本旅客鉄道	62,800	9,675.00	607,590,000	
東海旅客鉄道	58,500	22,245.00	1,301,332,500	
西武ホールディングス	94,600	1,930.00	182,578,000	
鴻池運輸	10,600	1,663.00	17,627,800	
西日本鉄道	20,000	2,629.00	52,580,000	
ハマキョウレックス	5,500	3,665.00	20,157,500	
サカイ引越センター	3,700	6,970.00	25,789,000	
近鉄グループホールディングス	66,600	6,150.00	409,590,000	
阪急阪神ホールディングス	88,900	4,745.00	421,830,500	
南海電気鉄道	32,100	3,040.00	97,584,000	
京阪ホールディングス	29,600	5,450.00	161,320,000	
神戸電鉄	1,700	3,990.00	6,783,000	

名古屋鉄道	54,500	3,495.00	190,477,500	
山陽電気鉄道	5,900	2,248.00	13,263,200	
日本通運	23,500	7,010.00	164,735,000	
ヤマトホールディングス	117,100	1,901.00	222,607,100	
山九	18,500	5,690.00	105,265,000	
丸全昭和運輸	5,700	3,110.00	17,727,000	
センコーグループホールディングス	35,900	917.00	32,920,300	
トナミホールディングス	1,800	5,120.00	9,216,000	
ニッコンホールディングス	23,800	2,730.00	64,974,000	
福山通運	8,400	4,185.00	35,154,000	
セイノーホールディングス	49,700	1,479.00	73,506,300	
神奈川中央交通	2,300	4,015.00	9,234,500	
日立物流	11,800	3,110.00	36,698,000	
丸和運輸機関	6,900	2,570.00	17,733,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	7,600	1,408.00	10,700,800	
九州旅客鉄道	59,600	3,780.00	225,288,000	
ＳＧホールディングス	70,000	2,633.00	184,310,000	
日本郵船	55,400	1,925.00	106,645,000	
商船三井	41,900	2,942.00	123,269,800	
川崎汽船	19,800	1,879.00	37,204,200	
ＮＳユナイテッド海運	4,400	2,319.00	10,203,600	
飯野海運	38,200	360.00	13,752,000	
乾汽船	5,800	1,148.00	6,658,400	
日本航空	122,300	3,391.00	414,719,300	
ＡＮＡホールディングス	122,200	3,758.00	459,227,600	
トランコム	2,000	7,800.00	15,600,000	
日新	6,300	1,743.00	10,980,900	
三菱倉庫	21,300	2,835.00	60,385,500	
三井倉庫ホールディングス	8,100	1,999.00	16,191,900	
住友倉庫	24,000	1,510.00	36,240,000	
澁澤倉庫	4,600	2,149.00	9,885,400	
東陽倉庫	20,900	336.00	7,022,400	
日本トランスシティ	17,300	548.00	9,480,400	
川西倉庫	3,200	1,054.00	3,372,800	
安田倉庫	7,500	995.00	7,462,500	
東洋埠頭	4,900	1,412.00	6,918,800	
上組	38,600	2,444.00	94,338,400	
近鉄エクスプレス	14,000	1,944.00	27,216,000	
エーアイテイー	6,400	968.00	6,195,200	
日本コンセプト	3,600	1,430.00	5,148,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	6,500	3,445.00	22,392,500	
システナ	24,400	1,756.00	42,846,400	

デジタルアーツ	3,500	6,320.00	22,120,000	
日鉄ソリューションズ	10,200	3,810.00	38,862,000	
キューブシステム	6,800	798.00	5,426,400	
コア	3,900	1,445.00	5,635,500	
ソリトンシステムズ	4,700	1,099.00	5,165,300	
ソフトクリエイトホールディングス	4,000	1,784.00	7,136,000	
ＴＩＳ	23,000	6,610.00	152,030,000	
電算システム	3,300	2,985.00	9,850,500	
グリー	49,700	523.00	25,993,100	
コーエーテクモホールディングス	14,100	2,684.00	37,844,400	
三菱総合研究所	3,300	4,190.00	13,827,000	
ファインデックス	7,600	1,194.00	9,074,400	
ブレインパッド	1,500	5,750.00	8,625,000	
ＫＬａｂ	14,000	850.00	11,900,000	
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	9,500	1,074.00	10,203,000	
ネクソン	196,800	1,501.00	295,396,800	
アイスタイル	18,700	809.00	15,128,300	
エムアップ	2,500	2,585.00	6,462,500	
エイチーム	6,700	1,138.00	7,624,600	
エニグモ	6,500	1,057.00	6,870,500	
コロプラ	23,200	1,273.00	29,533,600	
ブロードリーフ	36,100	709.00	25,594,900	
デジタルハーツホールディングス	5,400	1,022.00	5,518,800	
システム情報	4,300	1,114.00	4,790,200	
メディアドゥホールディングス	2,500	3,760.00	9,400,000	
じげん	19,600	554.00	10,858,400	
フィックスターズ	8,000	1,628.00	13,024,000	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	4,500	1,362.00	6,129,000	
オプティム	2,400	3,485.00	8,364,000	
セレス	3,200	1,219.00	3,900,800	
ＳＨＩＦＴ	1,800	7,980.00	14,364,000	
ティーガイア	6,100	2,619.00	15,975,900	
セック	1,500	3,885.00	5,827,500	
豆蔵ホールディングス	5,400	1,443.00	7,792,200	
テクマトリックス	5,000	2,325.00	11,625,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	17,300	2,397.00	41,468,100	
GMOペイメントゲートウェイ	11,500	7,910.00	90,965,000	
システムリサーチ	2,600	1,829.00	4,755,400	
インターネットイニシアティブ	10,600	2,553.00	27,061,800	
さくらインターネット	8,400	664.00	5,577,600	
GMOクラウド	1,800	2,917.00	5,250,600	
ＳＲＡホールディングス	4,400	2,546.00	11,202,400	

ｅＢＡＳＥ	4,800	1,197.00	5,745,600	
アバント	5,800	1,036.00	6,008,800	
アドソル日進	2,800	2,385.00	6,678,000	
フリービット	5,500	933.00	5,131,500	
コムチュア	7,900	2,402.00	18,975,800	
アステリア	5,700	647.00	3,687,900	
マークラインズ	4,300	2,090.00	8,987,000	
メディカル・データ・ビジョン	6,100	984.00	6,002,400	
ｇｕｍｉ	10,200	721.00	7,354,200	
モバイルファクトリー	2,300	1,396.00	3,210,800	
テラスカイ	3,000	2,851.00	8,553,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	3,900	1,694.00	6,606,600	
ダブルスタンダード	1,100	5,500.00	6,050,000	
オープンドア	4,000	1,784.00	7,136,000	
アカツキ	2,600	6,420.00	16,692,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	2,300	1,259.00	2,895,700	
ＬＩＮＥ	16,100	5,140.00	82,754,000	
チェンジ	1,800	2,516.00	4,528,800	
オークネット	5,800	1,345.00	7,801,000	
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	8,700	691.00	6,011,700	
マクロミル	13,600	1,025.00	13,940,000	
オロ	2,200	4,295.00	9,449,000	
サインポスト	1,500	1,833.00	2,749,500	
ソルクシーズ	4,400	951.00	4,184,400	
プロトコーポレーション	7,500	1,041.00	7,807,500	
野村総合研究所	115,100	2,309.00	265,765,900	
サイバネットシステム	6,500	784.00	5,096,000	
インテージホールディングス	10,700	964.00	10,314,800	
ソースネクスト	34,800	491.00	17,086,800	
インフォコム	7,700	2,468.00	19,003,600	
ラクスル	3,900	3,665.00	14,293,500	
アルテリア・ネットワークス	8,500	1,627.00	13,829,500	
フォーカスシステムズ	6,200	902.00	5,592,400	
クレスコ	2,500	3,580.00	8,950,000	
フジ・メディア・ホールディングス	67,100	1,497.00	100,448,700	
オービック	23,900	14,610.00	349,179,000	
ジャストシステム	11,200	5,660.00	63,392,000	
ＴＤＣソフト	7,200	899.00	6,472,800	
Ｚホールディングス	949,700	383.00	363,735,100	
トレンドマイクロ	30,900	6,000.00	185,400,000	
ＩＤホールディングス	3,900	1,440.00	5,616,000	
日本オラクル	13,900	10,030.00	139,417,000	

アルファシステムズ	2,700	2,804.00	7,570,800	
フューチャー	8,700	1,845.00	16,051,500	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	5,900	1,572.00	9,274,800	
ＳＢテクノロジー	3,000	1,991.00	5,973,000	
オービックビジネスコンサルタント	7,000	4,890.00	34,230,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	31,400	2,951.00	92,661,400	
アイティフォー	10,300	879.00	9,053,700	
大塚商会	37,200	4,420.00	164,424,000	
サイボウズ	9,700	1,198.00	11,620,600	
ソフトブレーン	5,500	567.00	3,118,500	
電通国際情報サービス	4,300	4,205.00	18,081,500	
デジタルガレージ	12,700	4,135.00	52,514,500	
ＥＭシステムズ	5,300	2,058.00	10,907,400	
ウェザーニューズ	3,000	3,440.00	10,320,000	
ＣＩＪ	8,200	1,005.00	8,241,000	
ＷＯＷＯＷ	3,500	2,701.00	9,453,500	
スカラ	6,400	787.00	5,036,800	
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	7,800	644.00	5,023,200	
ネットワンシステムズ	26,500	3,150.00	83,475,000	
アルゴグラフィックス	6,000	3,335.00	20,010,000	
マーベラス	13,100	758.00	9,929,800	
エイベックス	12,600	1,334.00	16,808,400	
日本ユニシス	21,700	3,595.00	78,011,500	
兼松エレクトロニクス	3,800	3,425.00	13,015,000	
東京放送ホールディングス	42,300	1,750.00	74,025,000	
日本テレビホールディングス	58,300	1,452.00	84,651,600	
朝日放送グループホールディングス	10,800	749.00	8,089,200	
テレビ朝日ホールディングス	19,700	1,769.00	34,849,300	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	47,000	464.00	21,808,000	
テレビ東京ホールディングス	6,000	2,303.00	13,818,000	
ビジョン	6,700	1,793.00	12,013,100	
コネクシオ	4,800	1,525.00	7,320,000	
日本電信電話	461,800	5,598.00	2,585,156,400	
ＫＤＤＩ	514,800	3,150.00	1,621,620,000	
ソフトバンク	627,400	1,483.50	930,747,900	
光通信	7,100	25,880.00	183,748,000	
ＮＴＴドコモ	510,100	3,007.00	1,533,870,700	
エムティーアイ	9,100	692.00	6,297,200	
ＧＭＯインターネット	27,500	2,269.00	62,397,500	
ＫＡＤＯＫＡＷＡ	19,100	1,776.00	33,921,600	
学研ホールディングス	2,500	7,490.00	18,725,000	
ゼンリン	14,000	1,907.00	26,698,000	

アイネット	4,700	1,525.00	7,167,500	
松竹	4,600	16,230.00	74,658,000	
東宝	41,500	4,465.00	185,297,500	
東映	2,600	17,170.00	44,642,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	182,800	1,518.00	277,490,400	
ピー・シー・エー	1,300	4,480.00	5,824,000	
ＤＴＳ	14,900	2,352.00	35,044,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	29,700	5,470.00	162,459,000	
シーイーシー	7,700	2,261.00	17,409,700	
カプコン	33,100	2,623.00	86,821,300	
ジャステック	6,400	1,120.00	7,168,000	
ＳＣＳＫ	16,000	5,770.00	92,320,000	
日本システムウエア	2,600	2,574.00	6,692,400	
アイネス	8,300	1,365.00	11,329,500	
ＴＫＣ	5,700	5,130.00	29,241,000	
富士ソフト	9,000	4,275.00	38,475,000	
ＮＳＤ	11,400	3,590.00	40,926,000	
コナミホールディングス	25,200	4,860.00	122,472,000	
福井コンピュータホールディングス	3,000	3,875.00	11,625,000	
ＪＢＣＣホールディングス	5,600	1,863.00	10,432,800	
ミロク情報サービス	6,300	3,385.00	21,325,500	
ソフトバンクグループ	548,100	4,236.00	2,321,751,600	
伊藤忠食品	1,900	5,220.00	9,918,000	
エレマテック	8,100	1,057.00	8,561,700	
ＪＡＬＵＸ	2,700	2,521.00	6,806,700	
あらた	5,600	4,315.00	24,164,000	
東京エレクトロン　デバイス	3,600	2,255.00	8,118,000	
フィールズ	8,500	499.00	4,241,500	
双日	378,200	351.00	132,748,200	
アルフレッサ　ホールディングス	76,500	2,303.00	176,179,500	
横浜冷凍	20,700	1,080.00	22,356,000	
アルコニックス	8,300	1,447.00	12,010,100	
神戸物産	23,800	3,390.00	80,682,000	
あい　ホールディングス	10,500	1,997.00	20,968,500	
ダイワボウホールディングス	5,900	5,580.00	32,922,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	16,900	1,874.00	31,670,600	
ラクト・ジャパン	2,800	3,480.00	9,744,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,500	1,108.00	14,958,000	
八洲電機	8,400	882.00	7,408,800	
レスターホールディングス	7,400	2,036.00	15,066,400	
ジューテックホールディングス	2,400	1,087.00	2,608,800	
ＴＯＫＡＩホールディングス	36,200	1,108.00	40,109,600	

三洋貿易	4,100	2,352.00	9,643,200	
ウイン・パートナーズ	5,600	1,486.00	8,321,600	
シップヘルスケアホールディングス	11,200	4,580.00	51,296,000	
コメダホールディングス	15,900	2,125.00	33,787,500	
小野建	7,500	1,348.00	10,110,000	
佐鳥電機	7,300	915.00	6,679,500	
伯東	5,300	1,311.00	6,948,300	
コンドーテック	5,800	1,102.00	6,391,600	
ナガイレーベン	10,600	2,561.00	27,146,600	
三菱食品	7,000	2,932.00	20,524,000	
松田産業	5,800	1,567.00	9,088,600	
第一興商	10,600	5,420.00	57,452,000	
メディパルホールディングス	74,300	2,372.00	176,239,600	
ＳＰＫ	2,600	2,850.00	7,410,000	
萩原電気ホールディングス	3,200	2,830.00	9,056,000	
アズワン	4,600	9,560.00	43,976,000	
尾家産業	3,600	1,347.00	4,849,200	
シモジマ	6,100	1,240.00	7,564,000	
ドウシシャ	6,800	1,810.00	12,308,000	
高速	5,500	1,184.00	6,512,000	
ハピネット	6,700	1,432.00	9,594,400	
日本ライフライン	20,400	1,544.00	31,497,600	
マルカ	3,300	2,298.00	7,583,400	
ＩＤＯＭ	21,000	530.00	11,130,000	
進和	4,700	2,352.00	11,054,400	
ダイトロン	3,900	1,697.00	6,618,300	
シークス	9,200	1,554.00	14,296,800	
オーハシテクニカ	5,700	1,462.00	8,333,400	
伊藤忠商事	484,900	2,438.00	1,182,186,200	
丸紅	722,300	825.20	596,041,960	
長瀬産業	39,000	1,628.00	63,492,000	
蝶理	4,900	1,974.00	9,672,600	
豊田通商	77,400	3,885.00	300,699,000	
三共生興	15,000	601.00	9,015,000	
兼松	24,900	1,412.00	35,158,800	
三井物産	609,200	1,967.50	1,198,601,000	
日本紙パルプ商事	4,100	4,060.00	16,646,000	
日立ハイテクノロジーズ	24,100	7,170.00	172,797,000	
カメイ	9,600	1,227.00	11,779,200	
スターゼン	2,700	4,405.00	11,893,500	
山善	26,100	1,045.00	27,274,500	
椿本興業	1,600	4,020.00	6,432,000	

住友商事	437,800	1,656.50	725,215,700	
内田洋行	3,200	5,240.00	16,768,000	
三菱商事	486,700	2,907.50	1,415,080,250	
第一実業	3,800	3,715.00	14,117,000	
キヤノンマーケティングジャパン	20,300	2,510.00	50,953,000	
西華産業	5,400	1,409.00	7,608,600	
佐藤商事	7,700	912.00	7,022,400	
菱洋エレクトロ	7,200	2,046.00	14,731,200	
東京産業	9,100	561.00	5,105,100	
ユアサ商事	6,200	3,500.00	21,700,000	
神鋼商事	2,200	2,654.00	5,838,800	
阪和興業	13,100	2,840.00	37,204,000	
正栄食品工業	4,700	3,385.00	15,909,500	
カナデン	7,000	1,325.00	9,275,000	
菱電商事	6,100	1,655.00	10,095,500	
フルサト工業	5,200	1,646.00	8,559,200	
岩谷産業	15,600	3,675.00	57,330,000	
極東貿易	3,200	2,194.00	7,020,800	
イワキ	12,300	476.00	5,854,800	
三愛石油	17,200	1,059.00	18,214,800	
稲畑産業	14,300	1,586.00	22,679,800	
明和産業	8,400	620.00	5,208,000	
ワキタ	15,700	1,095.00	17,191,500	
東邦ホールディングス	22,600	2,537.00	57,336,200	
サンゲツ	19,000	2,135.00	40,565,000	
ミツウロコグループホールディングス	10,700	1,420.00	15,194,000	
シナネンホールディングス	3,900	1,932.00	7,534,800	
伊藤忠エネクス	14,800	895.00	13,246,000	
サンリオ	19,500	2,234.00	43,563,000	
サンワテクノス	6,600	1,199.00	7,913,400	
リョーサン	7,700	2,947.00	22,691,900	
新光商事	11,700	900.00	10,530,000	
トーホー	4,300	1,873.00	8,053,900	
三信電気	4,400	1,700.00	7,480,000	
東陽テクニカ	10,000	1,140.00	11,400,000	
モスフードサービス	9,300	3,070.00	28,551,000	
加賀電子	7,100	2,468.00	17,522,800	
ソーダニッカ	10,500	611.00	6,415,500	
立花エレテック	5,800	1,758.00	10,196,400	
ＰＡＬＴＡＣ	11,000	5,400.00	59,400,000	
太平洋興発	6,600	808.00	5,332,800	
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	1,700	3,915.00	6,655,500	

国際紙パルプ商事	20,500	301.00	6,170,500	
ヤマタネ	4,800	1,504.00	7,219,200	
日鉄物産	4,600	5,070.00	23,322,000	
泉州電業	2,800	2,919.00	8,173,200	
トラスコ中山	14,200	2,799.00	39,745,800	
オートバックスセブン	26,100	1,801.00	47,006,100	
モリト	7,700	800.00	6,160,000	
加藤産業	10,600	3,665.00	38,849,000	
イノテック	5,800	1,052.00	6,101,600	
イエローハット	13,100	2,004.00	26,252,400	
ＪＫホールディングス	9,300	647.00	6,017,100	
日伝	6,600	2,096.00	13,833,600	
杉本商事	4,700	2,005.00	9,423,500	
因幡電機産業	19,400	2,671.00	51,817,400	
東テク	2,800	2,426.00	6,792,800	
ミスミグループ本社	86,700	2,738.00	237,384,600	
タキヒヨー	2,800	1,938.00	5,426,400	
スズケン	29,400	4,890.00	143,766,000	
ジェコス	7,200	955.00	6,876,000	
ローソン	17,700	6,080.00	107,616,000	
サンエー	5,600	5,050.00	28,280,000	
カワチ薬品	5,500	2,305.00	12,677,500	
エービーシー・マート	10,800	7,460.00	80,568,000	
アスクル	7,500	3,005.00	22,537,500	
ゲオホールディングス	12,700	1,318.00	16,738,600	
アダストリア	9,800	2,536.00	24,852,800	
くら寿司	3,700	4,885.00	18,074,500	
キャンドゥ	5,000	1,635.00	8,175,000	
パルグループホールディングス	3,700	3,575.00	13,227,500	
エディオン	31,100	1,187.00	36,915,700	
サーラコーポレーション	16,300	623.00	10,154,900	
ハローズ	2,900	2,580.00	7,482,000	
フジオフードシステム	3,400	3,570.00	12,138,000	
あみやき亭	2,200	3,645.00	8,019,000	
ひらまつ	20,500	305.00	6,252,500	
大黒天物産	2,100	3,210.00	6,741,000	
ハニーズホールディングス	7,100	1,390.00	9,869,000	
アルペン	5,900	1,840.00	10,856,000	
クオールホールディングス	10,600	1,584.00	16,790,400	
ジンズホールディングス	3,800	6,720.00	25,536,000	
ビックカメラ	40,300	1,213.00	48,883,900	
ＤＣＭホールディングス	36,400	1,069.00	38,911,600	

ＭｏｎｏｔａＲＯ	49,400	3,085.00	152,399,000	
ＤＤホールディングス	3,300	1,567.00	5,171,100	
アークランドサービスホールディングス	5,600	1,871.00	10,477,600	
Ｊ．フロント　リテイリング	82,700	1,473.00	121,817,100	
ドトール・日レスホールディングス	10,500	2,233.00	23,446,500	
マツモトキヨシホールディングス	28,400	4,200.00	119,280,000	
ブロンコビリー	3,900	2,741.00	10,689,900	
ＺＯＺＯ	48,000	2,206.00	105,888,000	
物語コーポレーション	1,800	8,630.00	15,534,000	
ココカラファイン	7,200	6,440.00	46,368,000	
三越伊勢丹ホールディングス	121,400	990.00	120,186,000	
Ｈａｍｅｅ	2,800	1,398.00	3,914,400	
ウエルシアホールディングス	20,600	6,790.00	139,874,000	
クリエイトＳＤホールディングス	9,500	2,676.00	25,422,000	
チムニー	3,000	2,308.00	6,924,000	
シュッピン	5,900	1,167.00	6,885,300	
ネクステージ	10,300	1,195.00	12,308,500	
ジョイフル本田	20,400	1,463.00	29,845,200	
鳥貴族	3,000	1,897.00	5,691,000	
キリン堂ホールディングス	3,200	2,059.00	6,588,800	
ホットランド	6,300	1,353.00	8,523,900	
すかいらーくホールディングス	77,900	2,217.00	172,704,300	
ＳＦＰホールディングス	3,700	2,200.00	8,140,000	
綿半ホールディングス	3,100	2,015.00	6,246,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	18,500	981.00	18,148,500	
ＢＥＥＮＯＳ	3,400	1,539.00	5,232,600	
あさひ	6,200	1,263.00	7,830,600	
日本調剤	2,300	3,780.00	8,694,000	
コスモス薬品	3,100	22,250.00	68,975,000	
セブン&アイ・ホールディングス	271,500	4,113.00	1,116,679,500	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	18,600	1,841.00	34,242,600	
ツルハホールディングス	15,000	13,070.00	196,050,000	
サンマルクホールディングス	5,400	2,332.00	12,592,800	
トリドールホールディングス	8,700	2,879.00	25,047,300	
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	7,300	717.00	5,234,100	
ジャパンミート	3,900	2,165.00	8,443,500	
バロックジャパンリミテッド	6,700	946.00	6,338,200	
クスリのアオキホールディングス	6,900	8,290.00	57,201,000	
力の源ホールディングス	4,100	872.00	3,575,200	
スシローグローバルホールディングス	7,600	8,560.00	65,056,000	
ＬＩＸＩＬビバ	7,000	1,917.00	13,419,000	

メディカルシステムネットワーク	9,200	576.00	5,299,200	
ノジマ	11,600	2,281.00	26,459,600	
カッパ・クリエイト	10,200	1,465.00	14,943,000	
良品計画	92,000	2,498.00	229,816,000	
アドヴァン	11,300	1,308.00	14,780,400	
アルビス	3,300	2,293.00	7,566,900	
コナカ	15,200	406.00	6,171,200	
Ｇ－７ホールディングス	2,100	4,500.00	9,450,000	
イオン北海道	8,400	799.00	6,711,600	
コジマ	14,100	459.00	6,471,900	
コーナン商事	9,400	2,548.00	23,951,200	
エコス	3,300	1,683.00	5,553,900	
ワタミ	9,000	1,312.00	11,808,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホ	166,000	1,798.00	298,468,000	
西松屋チェーン	15,400	1,005.00	15,477,000	
ゼンショーホールディングス	33,500	2,514.00	84,219,000	
幸楽苑ホールディングス	5,200	2,117.00	11,008,400	
サイゼリヤ	11,400	2,631.00	29,993,400	
ＶＴホールディングス	30,100	473.00	14,237,300	
フジ・コーポレーション	2,500	2,324.00	5,810,000	
ユナイテッドアローズ	7,500	3,340.00	25,050,000	
ハイデイ日高	9,600	2,187.00	20,995,200	
コロワイド	23,900	2,216.00	52,962,400	
ピーシーデポコーポレーション	11,800	478.00	5,640,400	
壱番屋	4,900	5,280.00	25,872,000	
スギホールディングス	13,900	6,170.00	85,763,000	
薬王堂ホールディングス	3,200	2,532.00	8,102,400	
ヴィア・ホールディングス	13,300	667.00	8,871,100	
スクロール	15,800	350.00	5,530,000	
ヨンドシーホールディングス	7,300	2,613.00	19,074,900	
ファミリーマート	55,500	2,601.00	144,355,500	
木曽路	9,100	2,880.00	26,208,000	
ＳＲＳホールディングス	11,200	1,044.00	11,692,800	
千趣会	17,800	432.00	7,689,600	
ケーヨー	18,800	539.00	10,133,200	
上新電機	8,000	2,465.00	19,720,000	
日本瓦斯	11,200	3,440.00	38,528,000	
ロイヤルホールディングス	11,800	2,542.00	29,995,600	
いなげや	8,900	1,480.00	13,172,000	
島忠	13,200	3,005.00	39,666,000	
チヨダ	7,600	1,617.00	12,289,200	
ライフコーポレーション	5,400	2,504.00	13,521,600	

リンガーハット	8,800	2,484.00	21,859,200	
ＭｒＭａｘＨＤ	12,500	499.00	6,237,500	
ＡＯＫＩホールディングス	13,600	1,134.00	15,422,400	
オークワ	11,000	1,443.00	15,873,000	
コメリ	10,500	2,363.00	24,811,500	
青山商事	14,600	1,677.00	24,484,200	
しまむら	8,000	8,970.00	71,760,000	
高島屋	51,600	1,304.00	67,286,400	
松屋	14,900	854.00	12,724,600	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	33,000	1,233.00	40,689,000	
近鉄百貨店	2,800	3,610.00	10,108,000	
パルコ	7,200	1,364.00	9,820,800	
丸井グループ	63,600	2,651.00	168,603,600	
アクシアル　リテイリング	5,600	3,870.00	21,672,000	
イオン	266,400	2,265.00	603,396,000	
イズミ	14,200	4,270.00	60,634,000	
平和堂	13,600	2,115.00	28,764,000	
フジ	8,500	1,971.00	16,753,500	
ヤオコー	7,600	5,110.00	38,836,000	
ゼビオホールディングス	8,800	1,328.00	11,686,400	
ケーズホールディングス	67,100	1,366.00	91,658,600	
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	6,300	651.00	4,101,300	
日産東京販売ホールディングス	17,800	278.00	4,948,400	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	3,700	2,539.00	9,394,300	
総合メディカルホールディングス	6,300	2,065.00	13,009,500	
ブックオフグループホールディングス	4,900	1,066.00	5,223,400	
アインホールディングス	9,500	6,880.00	65,360,000	
元気寿司	2,400	2,994.00	7,185,600	
ヤマダ電機	210,500	557.00	117,248,500	
アークランドサカモト	10,900	1,281.00	13,962,900	
ニトリホールディングス	30,000	17,260.00	517,800,000	
グルメ杵屋	6,200	1,195.00	7,409,000	
吉野家ホールディングス	23,500	2,756.00	64,766,000	
松屋フーズホールディングス	3,300	4,510.00	14,883,000	
サガミホールディングス	9,800	1,376.00	13,484,800	
関西スーパーマーケット	6,600	1,086.00	7,167,600	
王将フードサービス	5,000	6,620.00	33,100,000	
プレナス	7,800	1,936.00	15,100,800	
ミニストップ	5,800	1,472.00	8,537,600	
アークス	13,400	2,284.00	30,605,600	
バローホールディングス	14,800	2,064.00	30,547,200	
ベルク	3,200	5,230.00	16,736,000	

大庄	5,200	1,605.00	8,346,000	
ファーストリテイリング	9,300	67,800.00	630,540,000	
サンドラッグ	26,000	3,870.00	100,620,000	
サックスバー　ホールディングス	8,300	905.00	7,511,500	
ベルーナ	15,300	712.00	10,893,600	
じもとホールディングス	59,100	107.00	6,323,700	
めぶきフィナンシャルグループ	361,100	284.00	102,552,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,000	1,532.00	15,320,000	
九州フィナンシャルグループ	112,600	493.00	55,511,800	
ゆうちょ銀行	196,300	1,070.00	210,041,000	
富山第一銀行	19,600	346.00	6,781,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	409,100	447.00	182,867,700	
西日本フィナンシャルホールディングス	47,300	856.00	40,488,800	
関西みらいフィナンシャルグループ	41,100	732.00	30,085,200	
三十三フィナンシャルグループ	6,500	1,708.00	11,102,000	
第四北越フィナンシャルグループ	12,100	3,005.00	36,360,500	
新生銀行	50,800	1,717.00	87,223,600	
あおぞら銀行	41,100	2,818.00	115,819,800	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	4,780,600	582.10	2,782,787,260	
りそなホールディングス	760,700	466.80	355,094,760	
三井住友トラスト・ホールディングス	131,100	4,195.00	549,964,500	
三井住友フィナンシャルグループ	480,300	4,008.00	1,925,042,400	
千葉銀行	238,200	624.00	148,636,800	
群馬銀行	135,400	390.00	52,806,000	
武蔵野銀行	10,600	1,961.00	20,786,600	
千葉興業銀行	20,600	344.00	7,086,400	
筑波銀行	30,800	243.00	7,484,400	
七十七銀行	23,700	1,794.00	42,517,800	
青森銀行	5,400	2,831.00	15,287,400	
秋田銀行	5,200	2,259.00	11,746,800	
山形銀行	8,700	1,659.00	14,433,300	
岩手銀行	5,000	2,965.00	14,825,000	
東邦銀行	60,000	278.00	16,680,000	
東北銀行	4,000	1,034.00	4,136,000	
みちのく銀行	5,000	1,567.00	7,835,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	58,300	2,092.00	121,963,600	
静岡銀行	171,200	839.00	143,636,800	
十六銀行	9,000	2,662.00	23,958,000	
スルガ銀行	72,700	545.00	39,621,500	
八十二銀行	166,800	475.00	79,230,000	
山梨中央銀行	9,200	1,154.00	10,616,800	
大垣共立銀行	13,700	2,550.00	34,935,000	

福井銀行	5,900	1,734.00	10,230,600	
北國銀行	7,600	3,510.00	26,676,000	
清水銀行	2,900	2,180.00	6,322,000	
富山銀行	1,600	2,641.00	4,225,600	
滋賀銀行	13,700	2,743.00	37,579,100	
南都銀行	11,900	2,763.00	32,879,700	
百五銀行	64,700	354.00	22,903,800	
京都銀行	24,700	4,580.00	113,126,000	
紀陽銀行	24,500	1,724.00	42,238,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	46,800	1,134.00	53,071,200	
広島銀行	101,200	545.00	55,154,000	
山陰合同銀行	42,000	687.00	28,854,000	
中国銀行	60,000	1,097.00	65,820,000	
伊予銀行	97,600	608.00	59,340,800	
百十四銀行	7,600	2,258.00	17,160,800	
四国銀行	10,400	1,045.00	10,868,000	
阿波銀行	11,400	2,706.00	30,848,400	
大分銀行	4,200	2,854.00	11,986,800	
宮崎銀行	4,500	2,655.00	11,947,500	
佐賀銀行	4,700	1,740.00	8,178,000	
沖縄銀行	6,500	3,675.00	23,887,500	
琉球銀行	15,700	1,258.00	19,750,600	
セブン銀行	235,600	341.00	80,339,600	
みずほフィナンシャルグループ	9,433,600	169.70	1,600,881,920	
山口フィナンシャルグループ	87,800	757.00	66,464,600	
名古屋銀行	6,000	3,390.00	20,340,000	
北洋銀行	108,300	241.00	26,100,300	
愛知銀行	2,900	3,845.00	11,150,500	
中京銀行	3,000	2,257.00	6,771,000	
大光銀行	2,500	1,751.00	4,377,500	
愛媛銀行	10,200	1,224.00	12,484,800	
京葉銀行	30,800	629.00	19,373,200	
栃木銀行	39,600	231.00	9,147,600	
東和銀行	12,300	888.00	10,922,400	
トモニホールディングス	57,600	419.00	24,134,400	
フィデアホールディングス	73,000	134.00	9,782,000	
池田泉州ホールディングス	78,200	203.00	15,874,600	
ＦＰＧ	22,800	1,069.00	24,373,200	
ＳＢＩホールディングス	77,700	2,258.00	175,446,600	
ジャフコ	10,600	4,230.00	44,838,000	
大和証券グループ本社	557,300	556.10	309,914,530	
野村ホールディングス	1,223,100	562.30	687,749,130	

岡三証券グループ	62,600	406.00	25,415,600	
丸三証券	22,500	547.00	12,307,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82,400	338.00	27,851,200	
水戸証券	26,500	283.00	7,499,500	
いちよし証券	13,600	682.00	9,275,200	
松井証券	40,900	888.00	36,319,200	
マネックスグループ	56,100	281.00	15,764,100	
極東証券	11,100	785.00	8,713,500	
岩井コスモホールディングス	8,000	1,282.00	10,256,000	
藍澤證券	12,500	738.00	9,225,000	
スパークス・グループ	30,000	249.00	7,470,000	
かんぽ生命保険	24,900	1,876.00	46,712,400	
ＳＯＭＰＯホールディングス	130,600	4,371.00	570,852,600	
アニコム　ホールディングス	5,800	3,585.00	20,793,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	181,700	3,560.00	646,852,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	56,900	2,573.00	146,403,700	
第一生命ホールディングス	393,100	1,761.50	692,445,650	
東京海上ホールディングス	248,300	6,020.00	1,494,766,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	214,500	1,295.00	277,777,500	
アドバンスクリエイト	1,500	1,864.00	2,796,000	
全国保証	19,600	4,410.00	86,436,000	
Ｃａｓａ	3,000	1,263.00	3,789,000	
アルヒ	11,200	2,515.00	28,168,000	
プレミアグループ	4,000	2,336.00	9,344,000	
クレディセゾン	48,900	1,810.00	88,509,000	
芙蓉総合リース	7,300	7,230.00	52,779,000	
みずほリース	10,900	3,280.00	35,752,000	
東京センチュリー	14,000	5,990.00	83,860,000	
日本証券金融	32,200	543.00	17,484,600	
アイフル	111,700	252.00	28,148,400	
リコーリース	5,800	3,910.00	22,678,000	
イオンフィナンシャルサービス	42,500	1,685.00	71,612,500	
アコム	138,800	458.00	63,570,400	
ジャックス	7,800	2,696.00	21,028,800	
オリエントコーポレーション	195,600	162.00	31,687,200	
日立キャピタル	16,200	2,695.00	43,659,000	
アプラスフィナンシャル	44,100	93.00	4,101,300	
オリックス	434,300	1,797.50	780,654,250	
三菱ＵＦＪリース	176,200	705.00	124,221,000	
日本取引所グループ	199,500	1,874.00	373,863,000	
イー・ギャランティ	7,100	1,416.00	10,053,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,300	2,463.00	8,127,900	

いちご	90,200	439.00	39,597,800	
日本駐車場開発	85,300	166.00	14,159,800	
スター・マイカ・ホールディングス	4,500	1,776.00	7,992,000	
ヒューリック	149,000	1,254.00	186,846,000	
三栄建築設計	4,000	1,625.00	6,500,000	
野村不動産ホールディングス	42,200	2,653.00	111,956,600	
三重交通グループホールディングス	18,000	604.00	10,872,000	
サムティ	9,900	2,028.00	20,077,200	
ディア・ライフ	10,300	559.00	5,757,700	
日本商業開発	6,100	1,606.00	9,796,600	
プレサンスコーポレーション	11,100	1,756.00	19,491,600	
ユニゾホールディングス	10,800	4,900.00	52,920,000	
日本管理センター	5,800	1,319.00	7,650,200	
フージャースホールディングス	16,600	707.00	11,736,200	
オープンハウス	20,100	2,920.00	58,692,000	
東急不動産ホールディングス	188,200	744.00	140,020,800	
飯田グループホールディングス	56,600	1,953.00	110,539,800	
ムゲンエステート	8,200	800.00	6,560,000	
ビーロット	2,500	2,031.00	5,077,500	
ハウスドゥ	4,800	1,619.00	7,771,200	
ジェイ・エス・ビー	1,200	4,620.00	5,544,000	
パーク２４	37,700	2,575.00	97,077,500	
パラカ	3,100	2,033.00	6,302,300	
三井不動産	347,300	2,731.50	948,649,950	
三菱地所	487,000	2,010.00	978,870,000	
平和不動産	13,000	2,614.00	33,982,000	
東京建物	77,000	1,653.00	127,281,000	
ダイビル	18,400	1,172.00	21,564,800	
京阪神ビルディング	12,100	1,437.00	17,387,700	
住友不動産	156,500	3,839.00	600,803,500	
テーオーシー	15,000	895.00	13,425,000	
東京楽天地	1,700	6,140.00	10,438,000	
スターツコーポレーション	9,200	2,691.00	24,757,200	
フジ住宅	11,800	711.00	8,389,800	
空港施設	13,300	540.00	7,182,000	
ゴールドクレスト	5,900	2,162.00	12,755,800	
エスリード	3,800	2,171.00	8,249,800	
日神不動産	14,100	496.00	6,993,600	
日本エスコン	14,100	989.00	13,944,900	
タカラレーベン	33,500	489.00	16,381,500	
サンヨーハウジング名古屋	7,000	995.00	6,965,000	
イオンモール	35,700	1,775.00	63,367,500	

ファースト住建	5,200	1,319.00	6,858,800	
カチタス	8,800	4,920.00	43,296,000	
トーセイ	9,900	1,333.00	13,196,700	
サンフロンティア不動産	10,200	1,274.00	12,994,800	
エフ・ジェー・ネクスト	7,800	1,068.00	8,330,400	
ランドビジネス	7,400	761.00	5,631,400	
日本空港ビルデング	22,400	5,830.00	130,592,000	
日本工営	4,600	3,380.00	15,548,000	
ＬＩＦＵＬＬ	24,800	555.00	13,764,000	
ジェイエイシーリクルートメント	5,000	2,092.00	10,460,000	
日本M&Aセンター	50,900	3,750.00	190,875,000	
メンバーズ	2,300	2,358.00	5,423,400	
タケエイ	8,100	1,283.00	10,392,300	
トラスト・テック	8,100	1,353.00	10,959,300	
コシダカホールディングス	16,600	1,609.00	26,709,400	
パソナグループ	8,400	1,707.00	14,338,800	
リンクアンドモチベーション	16,300	726.00	11,833,800	
ＧＣＡ	9,800	953.00	9,339,400	
エス・エム・エス	21,300	3,005.00	64,006,500	
パーソルホールディングス	67,300	2,034.00	136,888,200	
リニカル	4,700	1,180.00	5,546,000	
クックパッド	28,300	372.00	10,527,600	
学情	3,400	1,589.00	5,402,600	
スタジオアリス	4,300	1,949.00	8,380,700	
シミックホールディングス	4,700	1,818.00	8,544,600	
綜合警備保障	26,700	5,810.00	155,127,000	
カカクコム	50,800	2,654.00	134,823,200	
アイロムグループ	3,300	1,456.00	4,804,800	
ルネサンス	4,900	1,746.00	8,555,400	
ディップ	9,500	3,115.00	29,592,500	
オプトホールディング	4,200	1,783.00	7,488,600	
新日本科学	9,300	786.00	7,309,800	
ツクイ	18,400	568.00	10,451,200	
ベネフィット・ワン	18,100	2,425.00	43,892,500	
エムスリー	148,300	3,055.00	453,056,500	
アウトソーシング	38,300	1,202.00	46,036,600	
ウェルネット	9,100	821.00	7,471,100	
ワールドホールディングス	2,700	1,969.00	5,316,300	
ディー・エヌ・エー	33,700	1,780.00	59,986,000	
博報堂ＤＹホールディングス	93,000	1,788.00	166,284,000	
ぐるなび	13,500	1,045.00	14,107,500	
タカミヤ	9,400	723.00	6,796,200	

ジャパンベストレスキューシステム	5,600	1,081.00	6,053,600	
ファンコミュニケーションズ	21,000	505.00	10,605,000	
ライク	3,200	1,697.00	5,430,400	
エスプール	14,200	711.00	10,096,200	
ＷＤＢホールディングス	3,300	2,534.00	8,362,200	
バリューコマース	4,300	2,001.00	8,604,300	
インフォマート	37,500	1,940.00	72,750,000	
ＪＰホールディングス	27,200	294.00	7,996,800	
ＥＰＳホールディングス	10,700	1,437.00	15,375,900	
プレステージ・インターナショナル	26,000	924.00	24,024,000	
アミューズ	4,100	3,120.00	12,792,000	
ドリームインキュベータ	3,100	1,670.00	5,177,000	
クイック	4,900	1,683.00	8,246,700	
ケネディクス	65,400	586.00	38,324,400	
電通	69,200	4,045.00	279,914,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,400	1,330.00	4,522,000	
ぴあ	2,100	4,820.00	10,122,000	
イオンファンタジー	2,800	3,160.00	8,848,000	
シーティーエス	9,000	753.00	6,777,000	
ネクシィーズグループ	2,800	1,882.00	5,269,600	
みらかホールディングス	19,400	2,751.00	53,369,400	
アルプス技研	6,300	1,825.00	11,497,500	
日本空調サービス	9,600	783.00	7,516,800	
オリエンタルランド	71,500	15,180.00	1,085,370,000	
ダスキン	17,400	3,050.00	53,070,000	
明光ネットワークジャパン	10,100	1,031.00	10,413,100	
ファルコホールディングス	5,100	1,763.00	8,991,300	
ラウンドワン	19,300	1,107.00	21,365,100	
リゾートトラスト	31,700	1,846.00	58,518,200	
ビー・エム・エル	8,600	3,205.00	27,563,000	
りらいあコミュニケーションズ	12,200	1,417.00	17,287,400	
リソー教育	32,300	413.00	13,339,900	
ユー・エス・エス	75,400	2,131.00	160,677,400	
サイバーエージェント	39,000	3,830.00	149,370,000	
楽天	313,900	942.00	295,693,800	
クリーク・アンド・リバー社	4,500	1,125.00	5,062,500	
テー・オー・ダブリュー	8,300	840.00	6,972,000	
山田コンサルティンググループ	3,800	1,826.00	6,938,800	
セントラルスポーツ	2,900	3,270.00	9,483,000	
フルキャストホールディングス	6,600	2,485.00	16,401,000	
エン・ジャパン	11,900	5,120.00	60,928,000	
テクノプロ・ホールディングス	13,500	7,480.00	100,980,000	

アイ・アールジャパンホールディングス	3,100	4,210.00	13,051,000	
Ｇｕｎｏｓｙ	5,300	1,658.00	8,787,400	
イー・ガーディアン	3,600	2,244.00	8,078,400	
ジャパンマテリアル	20,600	1,510.00	31,106,000	
ベクトル	9,300	1,139.00	10,592,700	
チャーム・ケア・コーポレーション	2,500	1,953.00	4,882,500	
ＩＢＪ	5,600	1,076.00	6,025,600	
アサンテ	3,700	2,027.00	7,499,900	
Ｎ・フィールド	7,000	703.00	4,921,000	
バリューＨＲ	1,700	3,505.00	5,958,500	
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	4,800	4,300.00	20,640,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,700	1,942.00	7,185,400	
シグマクシス	5,000	2,251.00	11,255,000	
ウィルグループ	5,100	1,157.00	5,900,700	
リクルートホールディングス	481,700	3,978.00	1,916,202,600	
エラン	4,400	1,710.00	7,524,000	
日本郵政	551,600	1,036.50	571,733,400	
ベルシステム２４ホールディングス	11,600	1,719.00	19,940,400	
鎌倉新書	5,400	1,928.00	10,411,200	
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	2,900	2,682.00	7,777,800	
エボラブルアジア	3,500	2,203.00	7,710,500	
アトラエ	2,000	3,835.00	7,670,000	
ストライク	2,600	4,380.00	11,388,000	
ソラスト	18,900	1,307.00	24,702,300	
インソース	3,500	3,435.00	12,022,500	
ベイカレント・コンサルティング	4,200	5,960.00	25,032,000	
グレイステクノロジー	3,300	2,961.00	9,771,300	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	7,300	2,933.00	21,410,900	
グリーンズ	4,300	1,222.00	5,254,600	
日総工産	5,200	1,083.00	5,631,600	
キュービーネットホールディングス	4,700	2,498.00	11,740,600	
ＲＰＡホールディングス	4,400	1,253.00	5,513,200	
スプリックス	3,100	1,260.00	3,906,000	
アドバンテッジリスクマネジメント	4,700	990.00	4,653,000	
リログループ	36,800	2,986.00	109,884,800	
東祥	4,800	2,454.00	11,779,200	
エイチ・アイ・エス	10,600	3,070.00	32,542,000	
共立メンテナンス	11,000	5,200.00	57,200,000	
イチネンホールディングス	8,300	1,415.00	11,744,500	
建設技術研究所	5,600	2,030.00	11,368,000	
燦ホールディングス	4,400	1,348.00	5,931,200	
東京テアトル	4,700	1,393.00	6,547,100	

ナガワ	2,100	7,530.00	15,813,000	
よみうりランド	2,100	4,540.00	9,534,000	
東京都競馬	4,600	3,475.00	15,985,000	
常磐興産	4,900	1,667.00	8,168,300	
カナモト	11,100	3,165.00	35,131,500	
東京ドーム	28,200	1,013.00	28,566,600	
西尾レントオール	6,800	3,085.00	20,978,000	
トランス・コスモス	6,400	2,874.00	18,393,600	
乃村工藝社	28,800	1,410.00	40,608,000	
藤田観光	3,700	2,868.00	10,611,600	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	4,800	1,511.00	7,252,800	
日本管財	6,400	1,951.00	12,486,400	
トーカイ	6,600	2,869.00	18,935,400	
セコム	71,300	9,486.00	676,351,800	
セントラル警備保障	3,300	6,460.00	21,318,000	
丹青社	13,100	1,232.00	16,139,200	
メイテック	8,500	5,830.00	49,555,000	
応用地質	7,900	1,400.00	11,060,000	
船井総研ホールディングス	13,700	2,546.00	34,880,200	
オオバ	8,200	798.00	6,543,600	
ベネッセホールディングス	22,700	2,908.00	66,011,600	
イオンディライト	8,100	3,870.00	31,347,000	
ナック	6,000	1,056.00	6,336,000	
ニチイ学館	9,900	1,621.00	16,047,900	
ダイセキ	11,300	3,260.00	36,838,000	
合　計	81,710,400		170,406,746,760	

(b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

②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。

２【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

2019年12月30日現在

Ⅰ　資産総額	27,508,717,697円
Ⅱ　負債総額	45,667,163円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	27,463,050,534円
Ⅳ　発行済口数	10,342,651,405口
Ⅴ　1口当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.6553円
（1万口当たり純資産額）	（26,553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た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。

ヘ　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。

第二部【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12月30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。

ハ　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。

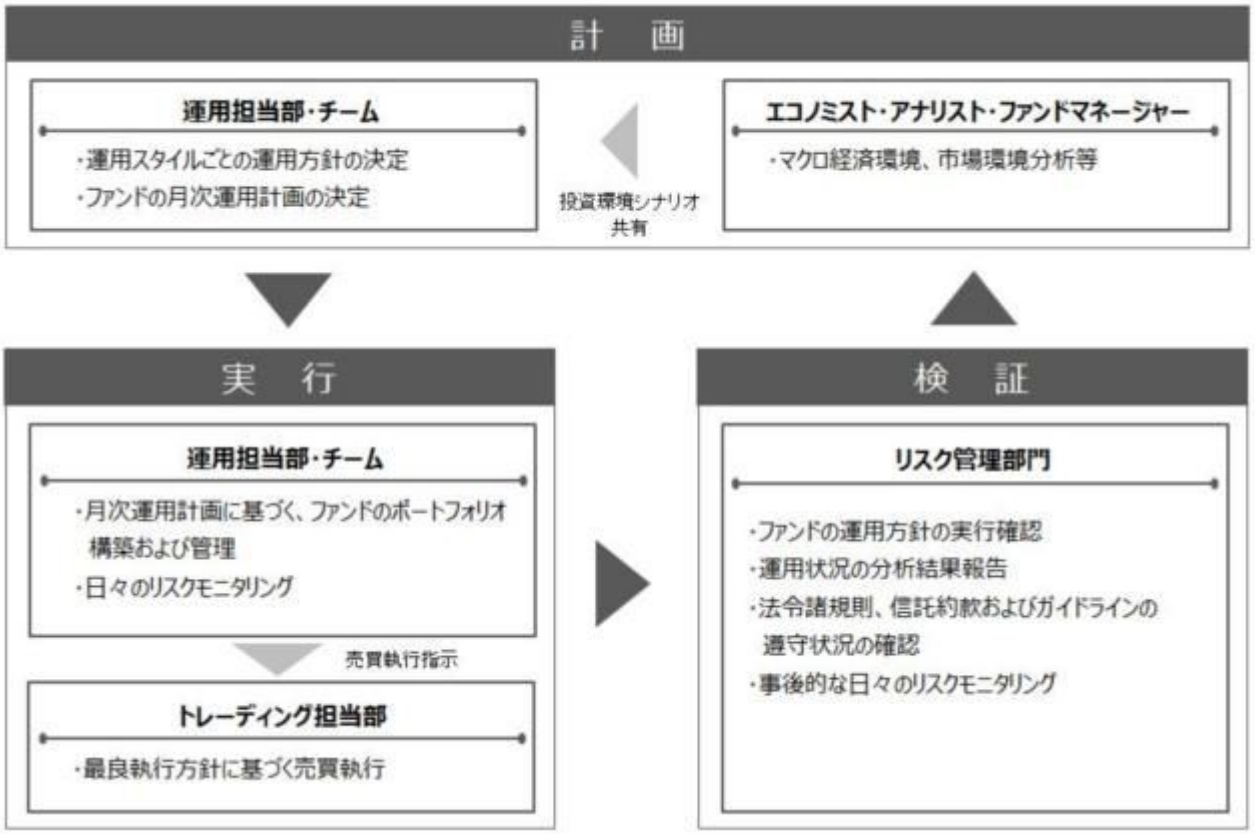
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

ニ　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12月30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	759	8,185,983
単位型株式投資信託	119	649,434
追加型公社債投資信託	1	30,235
単位型公社債投資信託	188	516,756
合　計	1,067	9,382,410

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。

また、当社の中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条及び第57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、第34期（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、第35期中間会計期間(平成31年４月１日から令和１年９月30日まで)の中間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 あずさ監査法人の中間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）
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	84	4,534
その他の預り金	92,326	1,480,229
未払金		
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
固定負債		
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
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	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 （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	354,695	1,462
投資有価証券償還損		141,666	13,668
投資有価証券売却損		9,634	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		
					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		
					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		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	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。

①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。

②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います。そのため、資金運用については、短期的で安全性の高い金融資産に限定し、財務体質の健全性、安全性、流動性の確保を第一とし、顧客利益に反しない運用を行っています。また、資金調達及びデリバティブ取引は行っていません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて１年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

①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。

②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			
①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			
①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)
その他有価証券		
非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	10,412,523	10,252,067
合計	10,412,523	10,252,067

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6)①その他有価証券」には含めておりません。

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

(注３)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成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
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		
その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

①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。

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

①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。

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	㈱三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% ―	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,761,066	未払手数料	429,436
親会社の子会社	SMBC日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	% ―	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	5,685,815	未払手数料	953,752

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

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

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・アドバイザリー・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アドバイザリー合同会社を、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。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

（単位：千円）

	第35期中間会計期間 （令和１年９月30日）

資産の部		
流動資産		
現金及び預金		31,390,396
顧客分別金信託		120,015
前払費用		518,120
未収委託者報酬		9,224,857
未収運用受託報酬		2,518,829
未収投資助言報酬		300,807
未収収益		49,098
その他		251,169
流動資産合計		44,373,295
固定資産		
有形固定資産	**※１**	1,165,925
無形固定資産		
のれん		35,720,818
顧客関連資産		18,841,803
その他		1,287,309
無形固定資産合計		55,849,931
投資その他の資産		
投資有価証券		19,980,993
関係会社株式		11,208,183
その他		2,725,272
貸倒引当金		△ 20,750
投資その他の資産合計		33,893,699
固定資産合計		90,909,555
資産合計		135,282,851
負債の部		
流動負債		
リース債務		1,568
顧客からの預り金		3,725
その他の預り金		117,464
未払金		4,558,058
未払費用		4,003,445
未払法人税等		1,108,639
前受収益		37,155
賞与引当金		1,620,047
資産除去債務		248,260
その他	**※２**	262,615
流動負債合計		11,960,980
固定負債		
リース債務		1,045
退職給付引当金		5,317,984
賞与引当金		2,537
その他		218,125
繰延税金負債		3,515,376
固定負債合計		9,055,069
負債合計		21,016,049
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		81,927,000
資本剰余金合計		90,555,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245

その他利益剰余金	
配当準備積立金	60,000
別途積立金	1,476,959
繰越利益剰余金	19,373,541
利益剰余金合計	21,194,745
株主資本合計	113,750,729
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	516,072
評価・換算差額等合計	516,072
純資産合計	114,266,801
負債純資産合計	135,282,851

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第35期中間会計期間 （自　平成31年４月１日 至　令和１年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		28,593,570
運用受託報酬		4,633,054
投資助言報酬		661,581
その他の営業収益		118,885
営業収益計		34,007,092
営業費用		21,567,446
一般管理費	※１	11,224,956
営業利益		1,214,689
営業外収益	※２	258,897
営業外費用	※３	41,920
経常利益		1,431,666
特別損失	※４	11,471
税引前中間純利益		1,420,194
法人税、住民税及び事業税		950,377
法人税等調整額		△ 118,269
法人税等合計		832,107
中間純利益		588,086

(3)中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自　平成31年４月１日　至　令和１年９月30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	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	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	21,255,054
当中間期変動額								
剰余金の配当								△ 2,469,600
中間純利益								588,086
合併による増加			81,927,000	81,927,000				

株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）								
当中間期変動額合計	－	－	81,927,000	81,927,000	－	－	－	△ 1,881,513
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,373,541

	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	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当中間期変動額					
剰余金の配当	△ 2,469,600	△ 2,469,600			△ 2,469,600
中間純利益	588,086	588,086			588,086
合併による増加		81,927,000			81,927,000
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）			△ 77,989	△ 77,989	△ 77,989
当中間期変動額合計	△ 1,881,513	80,045,486	△ 77,989	△ 77,989	79,967,497
当中間期末残高	21,194,745	113,750,729	516,072	516,072	114,266,801

注記事項

（重要な会計方針）

１．資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

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

中間会計期間末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（リース資産を除く）

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　　２～50年

器具備品　　３～20年

(2)無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な償却年数は次のとおりであります。

のれん　　14年

顧客関連資産　　６～19年

ソフトウェア（自社利用分）　　５年（社内における利用可能期間）

(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。

３．引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

債権の貸倒れ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。

(2)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中間会計期間の負担額を計上しております。

(3)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、当中間会計期間にお

いて発生していると認められる額を計上しております。

①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中間会計期間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。

②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．その他中間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）

（中間損益計算書）

当社は当中間会計期間より、「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」を「特別利益」ではなく「営業外収益」として、「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」を「特別損失」ではなく「営業外費用」として表示する方法に変更しております。これは、合併を契機に検討した結果、投資有価証券の売却及び償還の大勢が自社設定投信等の処分によるものであり毎期経常的に発生するものとして、当中間会計期間から取引実態に沿った表示へと変更したものであります。

この結果、従来の方法に比較して、「特別利益」は23,677千円減少し、「営業外収益」は同額増加しており、「特別損失」は30,023千円減少し、「営業外費用」は同額増加しております。また、「経常利益」は6,346千円減少しております。

（中間貸借対照表関係）

第35期中間会計期間 （令和１年９月30日）
※１.有形固定資産の減価償却累計額 1,557,220千円
※２.消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
※３.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。 当中間会計期間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。 当座借越極度額の総額　10,000,000千円 借入実行残高　－ 差引額　10,000,000千円
※４.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA)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150,945千円の支払保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

第35期中間会計期間 （自　平成31年４月１日　至　令和１年９月30日）
※１.のれん償却費　1,322,993千円 減価償却実施額 有形固定資産　287,191千円 無形固定資産　1,187,351千円
※２.営業外収益のうち主要なもの 受取配当金　209,815千円 投資有価証券償還益　5,197千円 投資有価証券売却益　18,480千円
※３.営業外費用のうち主要なもの 為替差損　11,810千円 投資有価証券償還損　22,585千円 投資有価証券売却損　7,437千円
※４.特別損失のうち主要なもの 合併関連費用　6,094千円 合併関連費用は、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等であります。 固定資産除却損　5,377千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自　平成31年４月１日　　至　令和１年９月30日）

１．発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首株式数	当中間会計期間増加株式数	当中間会計期間減少株式数	当中間会計期間末株式数
普通株式	17,640,000株	16,230,060株	－	33,870,060株

（変動事由の概要）

合併に伴う普通株式の発行による増加　　16,230,060株

２．剰余金の配当に関する事項

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
令和１年６月24日臨時株主総会	普通株式	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）

第35期中間会計期間 （自　平成31年４月１日　　至　令和１年９月30日）
１．オペレーティング・リース取引 （借主側） 未経過リース料（解約不能のもの） １年以内　　1,675,025千円 １年超　　6,419,696千円 合　　計　　8,094,721千円

（金融商品関係）

１．金融商品の時価等に関する事項

第35期中間会計期間（令和１年９月30日）

令和１年９月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。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、次表には含まれておりません（（注２）参照）。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	31,390,396	31,390,396	－
(2)顧客分別金信託	120,015	120,015	－
(3)未収委託者報酬	9,224,857	9,224,857	－
(4)未収運用受託報酬	2,518,829	2,518,829	－
(5)未収投資助言報酬	300,807	300,807	－
(6)投資有価証券			
①その他有価証券	19,935,624	19,935,624	－
(7)投資その他の資産			
①長期差入保証金	2,528,392	2,528,392	－
資産計	66,018,923	66,018,923	－
(1)顧客からの預り金	3,725	3,725	－
(2)未払金			
①未払手数料	4,192,554	4,192,554	－
負債計	4,196,280	4,196,280	－

（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おります。

（6）投資有価証券

①その他有価証券

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。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

（7）投資その他の資産

①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おります。

負　債

（1）顧客からの預り金、及び（2）未払金①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

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	45,369
合計	45,369
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	11,208,183
合計	11,208,183

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6)①その他有価証券」には含めておりません。

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

（有価証券関係）

第35期中間会計期間（令和１年９月30日）

１．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額　11,208,183千円）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

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	12,082,796	11,176,487	906,308
小計	12,082,796	11,176,487	906,308
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	7,852,827	8,004,506	△151,679
小計	7,852,827	8,004,506	△151,679
合計	19,935,624	19,180,994	754,629

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額　45,369千円）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。

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（企業結合等関係）

（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その事業の内容

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) 企業結合を行った主な理由

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31年１月16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31年１月16日)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

２.中間財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

平成31年４月１日から令和１年９月30日

３.被取得企業の取得原価及び対価の種類ごとの内訳

取得の対価	**企業結合日に交付した当社の普通株式の時価**	**81,927,000千円**
取得原価		**81,927,000千円**

４.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・アドバイザリー・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アドバイザリー合同会社を、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

５.主要な取得関連費用の内容及び金額

業務委託費用及びデューデリジェンス費用等　　37,723千円

６.発生したのれんの金額、発生原因、償却方法及び償却期間

(1) 発生したのれんの金額

37,043,811千円

(2) 発生原因

被取得企業から受け入れた資産及び引き受けた負債の純額と取得原価との差額によります。

(3) 償却方法及び償却期間

14年にわたる均等償却

７.企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

流動資産	**24,546,329千円**
固定資産	**34,001,531千円**
資産合計	**58,547,860千円**
流動負債	**5,406,939千円**
固定負債	**8,257,731千円**
負債合計	**13,664,671千円**

（資産除去債務関係）

当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

	当中間会計期間 （自　平成31年４月１日 至　令和１年９月30日）
期首残高	－
合併による増加額（注）	248,260
中間期末残高	248,260

（注）合併に伴い主として霞ヶ関オフィスの不動産賃貸契約に伴う原状回復義務等について、資産除去債務の金額を計上しております。
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。

（セグメント情報等）

第35期中間会計期間（自　平成31年４月１日　至　令和１年９月30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	28,593,570	4,633,054	661,581	118,885	34,007,092

(2)地域ごとの情報

①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中間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。

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中間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、中間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

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

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。

（１株当たり情報）

第35期中間会計期間 （自　平成31年４月１日　至　令和１年９月30日）
１株当たり純資産額　3,373円68銭 １株当たり中間純利益　17円36銭 なお、潜在株式調整後１株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（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 業務執行社員	公認会計士	飯田浩司	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	佐藤栄裕	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　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）　XBRL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			
ソフトウエア		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	
			資本剰余金		その他利益剰余金

		資本準備金	合計	利益準備金	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	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	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	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	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	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）

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

総平均法による原価法を採用しております。

(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（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。

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。

2.固定資産の減価償却の方法

(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。

建物　　2～30年

器具備品　　4～15年

（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。

(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エアについては、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。

(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。

3.引当金の計上基準

(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。

(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。

(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。

(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。

(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。

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。

（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ＳＭＡＭ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

①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。

②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。

③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

（単位：千円）

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）その他有価証券 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）その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 その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 その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.その他有価証券

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、ＳＭＡＭとの合併契約書に基づき、当社を消滅会社とし、ＳＭＡＭ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.　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。

b.　2020年1月24日付で、総則の「目的」に関する事項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ＤＳ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9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9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
ＳＭＢＣ日興証券株式会社	10,000百万円	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。
損保ジャパン日本興亜ＤＣ証券株式会社	3,000百万円	
野村證券株式会社	10,000百万円	
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595百万円	保険業法に基づき、損害保険業を営んでいます。
住友生命保険相互会社	639,000百万円	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。
日本生命保険相互会社	1,400,000百万円	

※資本金の額は、2019年9月末現在。
※住友生命保険相互会社および日本生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、基金および基金償却積立金の合計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。）
販売会社である三井住友海上火災保険株式会社は、委託会社株式を15.0%保有しています。
販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を10.4%保有しています。

第３【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年 2月25日	有価証券届出書
2019年 2月25日	有価証券報告書
2019年 4月 1日	有価証券届出書の訂正届出書
2019年 8月28日	有価証券届出書
2019年 8月28日	半期報告書

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．ＸＢＲＬデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

令和2年1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、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・日本株式インデックス年金ファンドの平成30年12月1日から令和1年12月2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・日本株式インデックス年金ファンドの令和1年12月2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11月22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	羽　太　典　明　　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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	佐　藤　栄　裕　　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の平成31年４月１日から令和２年３月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（平成31年４月１日から令和１年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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DSアセットマネジメント株式会社の令和１年９月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成31年４月１日から令和１年９月30日まで）の経営成績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
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．ＸＢＲＬデータは中間監査の対象には含まれていません。