

【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8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・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド
【発行者名】	三井住友D S アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【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。

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

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

ファンドの特色

1

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

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



TOPIXとは

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

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

2

株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

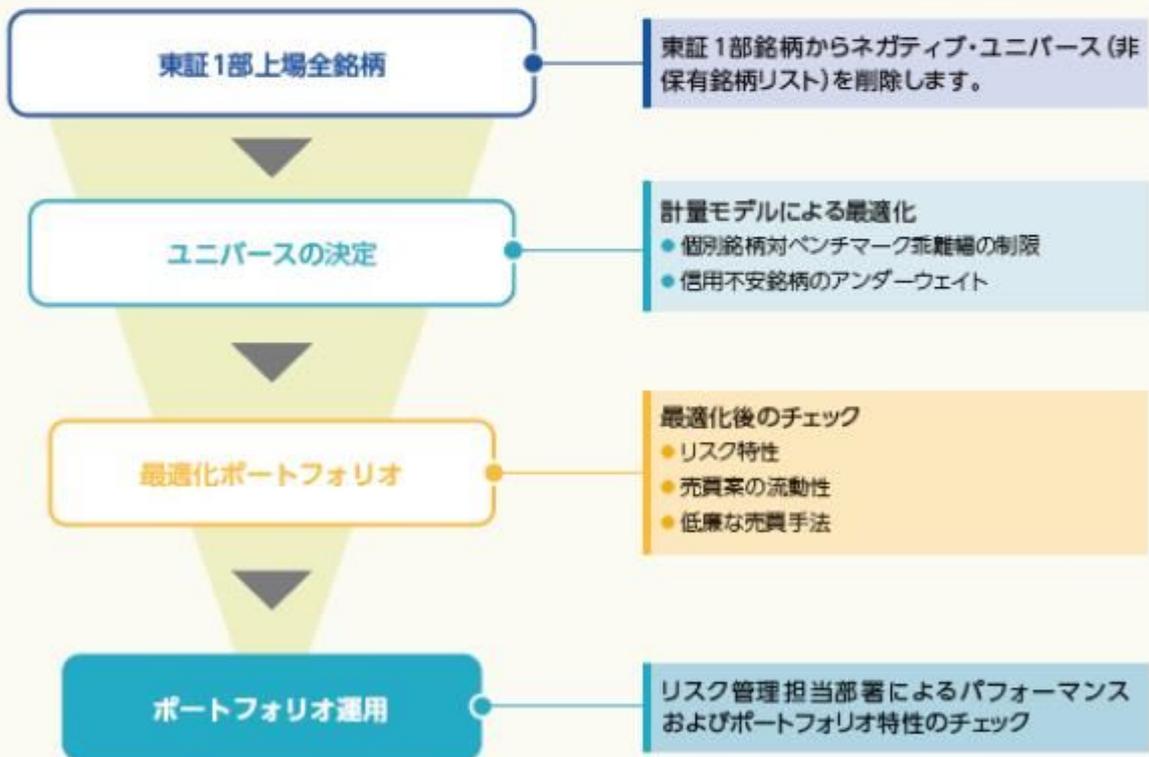
※ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

ファンドのしくみ

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



運用プロセス



最適化(法)とは

計量モデル等に基づいて、インデックスとの連動性を保てるようにインデックス構成銘柄の一部を抽出してポートフォリオを構築する方法です。

※上記の運用プロセスは今後変更される場合があります。

日本航空電子工業	16,000	2,104.00	33,664,000
T O A	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
O B A R A G R O U P	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	
K O A	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	
S C R E E Nホールディングス	12,300	7,600.00	93,480,000	
キャノン電子	7,500	2,075.00	15,562,500	
キャノン	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	
日本車輛製造	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
H O Y A	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
前田工織	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
S H O E I	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
N I S S H A	14,800	1,133.00	16,768,400
T A K A R A & C O M P A N Y	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ANDARD	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
S G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
N S 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
A N A 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
エーアイティー	6,400	968.00	6,195,200
日本コンセプト	3,600	1,430.00	5,148,000
NEC ネットエスアイ	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
ソフトクリエイイトホールディングス	4,000	1,784.00	7,136,000
T I S	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
K L a b	14,000	850.00	11,900,000
ポルトゥウィン・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
オブティム	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・テクノロジー	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
S B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
C I J	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J S A T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
K D D I	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
N T T 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
G M O インターネット	27,500	2,269.00	62,397,500
K A D O K A W A	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
D T S	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
カブコン	33,100	2,623.00	86,821,300
ジャステック	6,400	1,120.00	7,168,000
S C S K	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
T K C	5,700	5,130.00	29,241,000
富士ソフト	9,000	4,275.00	38,475,000
N S D	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
J B C C 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
J A L U X	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
ジュテックホールディングス	2,400	1,087.00	2,608,800
T O K A I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
佐島電機	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
メディバルホールディングス	74,300	2,372.00	176,239,600
S P K	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
I D O M	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
キャ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
トーヨー	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
PALTA C	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
J K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

キャンドウ	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	
ジー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	
D C M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	
Z O Z O	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	
クリエイティブ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	
S F P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	
B E E N O S	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
パ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ピバ	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
カップ・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
V T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	
S R S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	
Mr M a x H D	12,500	499.00	6,237,500	
A O K I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	
ケースホールディングス	67,100	1,366.00	91,658,600	
O l y m p i c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	
パ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	
サックスパー 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
F P G	22,800	1,069.00	24,373,200
S B I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
藍澤証券	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
S O M P O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
M S & A D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
C a s a	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
ビーロッド	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
バラカ	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

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D Y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
J Pホールディングス	27,200	294.00	7,996,800
E P Sホールディングス	10,700	1,437.00	15,375,900
prestige・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

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	
R P A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	
K N T - C T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。

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・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド

2019年12月30日現在

資産総額	32,102,133,132円
負債総額	63,652,070円
純資産総額（ - ）	32,038,481,062円
発行済口数	11,928,361,002口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6859円
（1万口当たり純資産額）	（26,859円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

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

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

へ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【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。

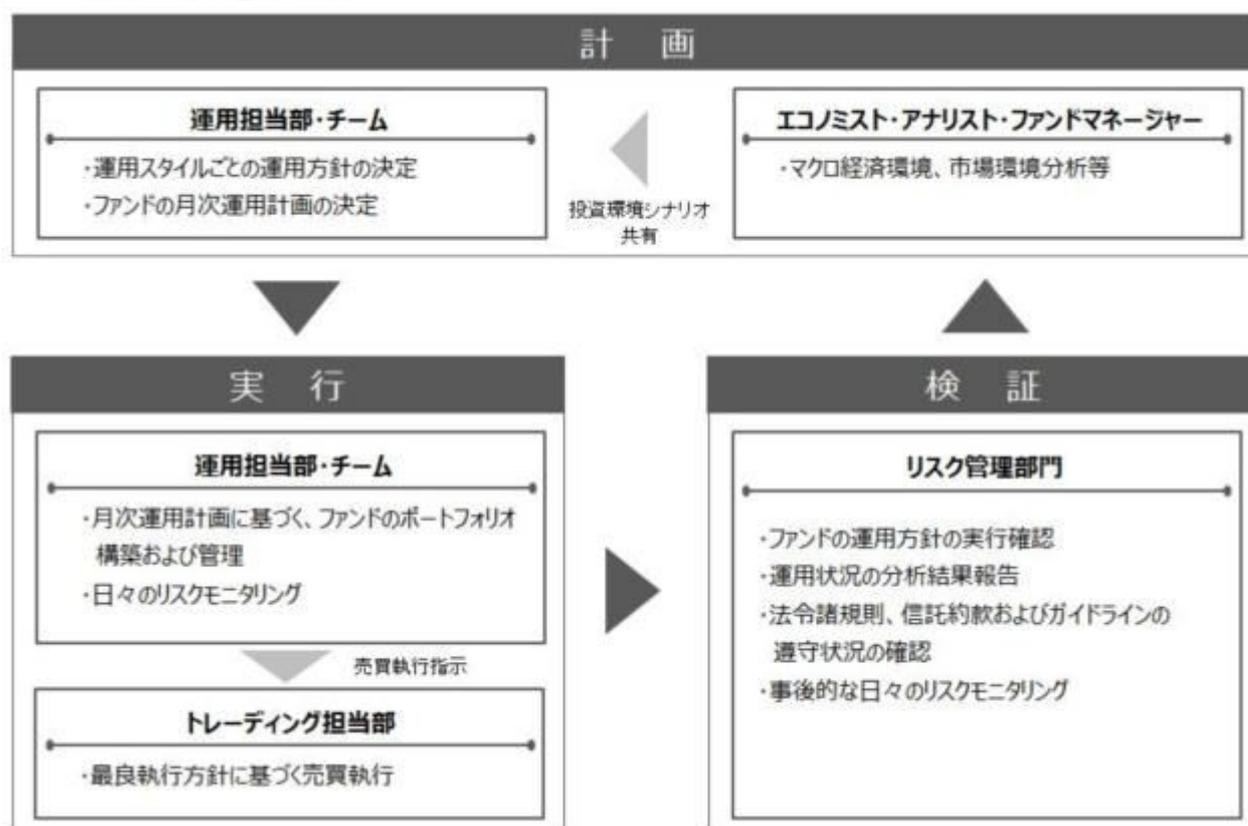
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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

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。

(1)現金及び預金	13,755,961	13,755,961	-
(2)顧客分別金信託	20,011	20,011	-
(3)未収委託者報酬	6,963,077	6,963,077	-
(4)未収運用受託報酬	1,129,548	1,129,548	-
(5)未収投資助言報酬	285,668	285,668	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	10,829,330	10,829,330	-
(7)長期差入保証金	2,004,451	2,004,451	-
資産計	34,988,051	34,988,051	-
(1)顧客からの預り金	4,534	4,534	-
(2)未払手数料	3,246,133	3,246,133	-
負債計	3,250,667	3,250,667	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金及び(2)未払手数料

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

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

(単位：千円)

区分	前事業年度 (平成30年3月31日)	当事業年度 (平成31年3月31日)
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)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
----	------	---------	----------	------

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

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	39,156,499	6,277,217	1,332,888	232,009	46,998,614

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1.関連当事者との取引

(1)兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
----	------------	-----	-------------	-----------	----------------	-----------	-------	------	----	------

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			利益準備金	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		配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金
当期末首残高	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				

(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 その他有価証券	19,935,624	19,935,624	-
(7)投資その他の資産 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 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

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

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 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) 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、記載していません。

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、記載していません。

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

(3) 交付した株式数

普通株式：16,230,060株

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

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。

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 公認会計士 飯田 浩 司 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 佐藤 榮 裕 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友DSアセットマネジメント株式会社（旧会社名 大和住銀投信投資顧問株式会社）の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第47期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社と三井住友アセットマネジメント株式会社は、平成31年4月1日付で合併した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

〔注1〕 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

〔注2〕 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			
ソフトウェア		73,887	159,087
ソフトウェア仮勘定		-	6,115
電話加入権		12,706	12,706
無形固定資産計		86,593	177,909
投資その他の資産			
投資有価証券		10,257,600	11,025,039
関係会社株式		956,115	956,115
従業員長期貸付金		1,170	-
長期差入保証金		534,699	534,270
出資金		82,660	82,660
繰延税金資産		1,041,251	1,009,250
その他		-	8,397
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産計		12,852,746	13,594,982
固定資産計		13,145,052	14,103,090
資産合計		39,333,840	38,649,419

(単位：千円)

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

退職給付引当金	1,540,203	1,707,062
役員退職慰労引当金	88,050	-
長期未払金	-	204,333
資産除去債務	-	248,260
固定負債計	1,632,952	2,164,829
負債合計	7,291,585	7,571,769

(単位：千円)

	第46期 (平成30年3月31日)	第47期 (平成31年3月31日)
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	156,268	156,268
資本剰余金合計	156,268	156,268
利益剰余金		
利益準備金	343,731	343,731
その他利益剰余金		
別途積立金	1,100,000	1,100,000
繰越利益剰余金	28,387,042	27,516,774
利益剰余金合計	29,830,773	28,960,505
株主資本合計	31,987,042	31,116,774
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	55,213	39,124
評価・換算差額等合計	55,213	39,124
純資産合計	32,042,255	31,077,650
負債純資産合計	39,333,840	38,649,419

(2) 損益計算書

(単位：千円)

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

協会費	24,374	24,325
諸会費	3,778	1,994
その他	122,930	63,596
営業費用計	17,381,079	16,727,567
一般管理費		
給料		
役員報酬	218,127	217,030
給料・手当	2,809,008	3,002,836
賞与	86,028	48,878
退職金	9,864	2,855
福利厚生費	647,269	638,399
交際費	29,121	38,883
旅費交通費	159,224	153,694
租税公課	199,255	160,817
不動産賃借料	622,807	639,392
退職給付費用	219,724	324,082
固定資産減価償却費	71,624	141,154
賞与引当金繰入額	1,263,100	1,007,040
役員退職慰労引当金繰入額	36,130	102,860
役員賞与引当金繰入額	85,500	72,900
諸経費	901,001	1,011,941
一般管理費計	7,357,787	7,562,768
営業利益	6,839,032	4,444,730
営業外収益		
受取配当金	23,350	35,946
受取利息	199	178
投資有価証券売却益	6,350	45,345
その他	2,831	10,431
営業外収益計	32,732	91,902
営業外費用		
投資有価証券売却損	5,000	4,735
解約違約金	-	982
為替差損	1,784	828
その他	0	410
営業外費用計	6,784	6,956
経常利益	6,864,980	4,529,676
特別損失		
合併関連費用	2	179,376
固定資産除却損	-	4,121
特別損失計	-	183,498
税引前当期純利益	6,864,980	4,346,177
法人税、住民税及び事業税	2,242,775	1,339,010
法人税等調整額	78,014	73,635
法人税等合計	2,164,761	1,412,646
当期純利益	4,700,218	2,933,531

(3) 株主資本等変動計算書

第46期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		利益剰余金
			資本剰余金	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		利益準備金	利益剰余金	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金	
				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）

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

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
----	-------	----------------	-------	-----------------	-----	-------

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

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

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

2.金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表に含めておりません(注2)を参照ください)。

第46期(平成30年3月31日)

(単位:千円)

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

(*)金融商品に該当するものを表示しております。

第47期(平成31年3月31日)

(単位:千円)

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

(*)金融商品に該当するものを表示しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

- (5)投資有価証券

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

- (6)長期差入保証金

敷金の性質及び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。

(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	第47期
	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	(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	第47期
	(平成30年3月31日)	(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主な原因別の内訳

(単位：千円)

	第46期	第47期
	(平成30年3月31日)	(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

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

