

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年8月27日提出
【発行者名】	三井住友D Sアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 猿田 隆
【本店の所在の場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【事務連絡者氏名】	土屋 裕子
【電話番号】	03-6205-1649
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・日本株式インデックス年金ファンド
【届出の対象とした募集(売出)内国投資 信託受益証券の金額】	2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド
以下「当ファンド」といいます。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

2兆5,000億円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「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	コールセンター	ホームページ
三井住友D Sアセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	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。

（５）【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2020年8月28日から2021年2月25日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ 日本以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

ニ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主として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
	海外	債券	
追加型	内外	不動産投信	特殊型
		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	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
不動産投信	その他 ()	中南米	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))		アフリカ		
資産複合 ()		中近東(中東)		その他 ()
資産配分固 定型		エマージング		
資産配分変 更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(2) 【ファンドの沿革】

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D Sアセットマネジメント株式会社」

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

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

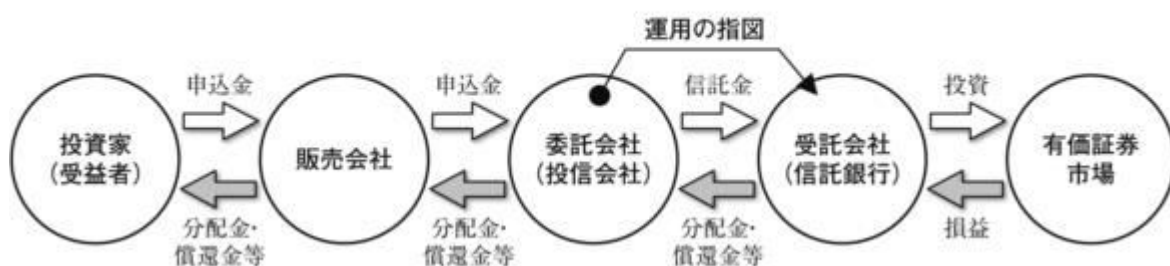
証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、株式会社日本カストディ銀行^{*}に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

^{*}株式会社日本カストディ銀行は、2020年7月27日に日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社、資産管理サービス信託銀行株式会社およびJTCホールディングス株式会社が合併して発足しました。

(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、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。

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2020年6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D Sアセットマネジメント株式会社に商号変更

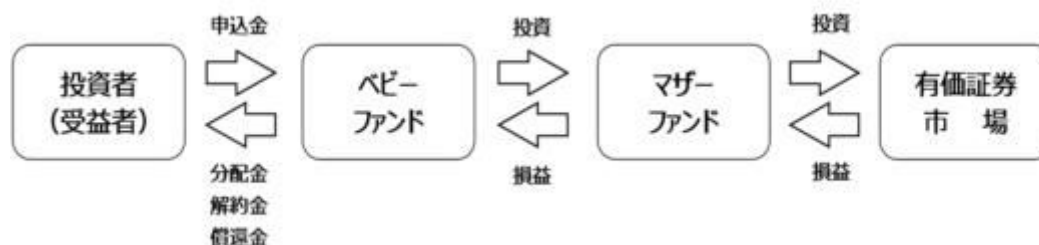
(八) 大株主の状況

(2020年6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

八 ファンドの運用形態（ファミリーファンド方式による運用）

「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。



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、T O P I X（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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、T O P I X（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (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。

- (八) 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。
- (二) 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。

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。

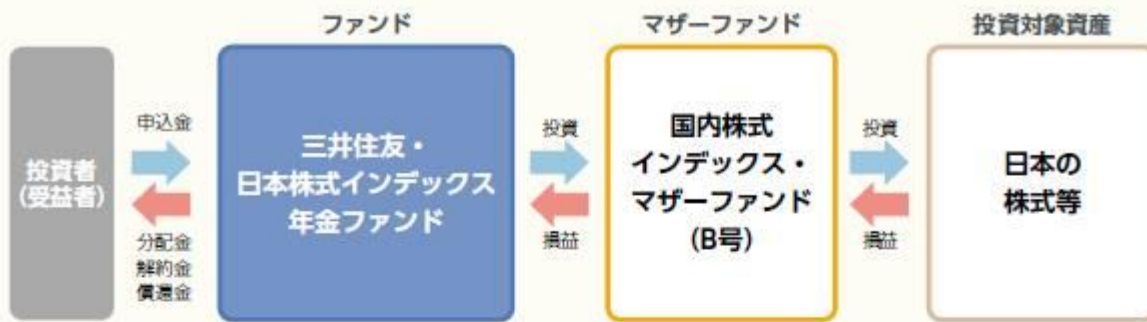
2

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。

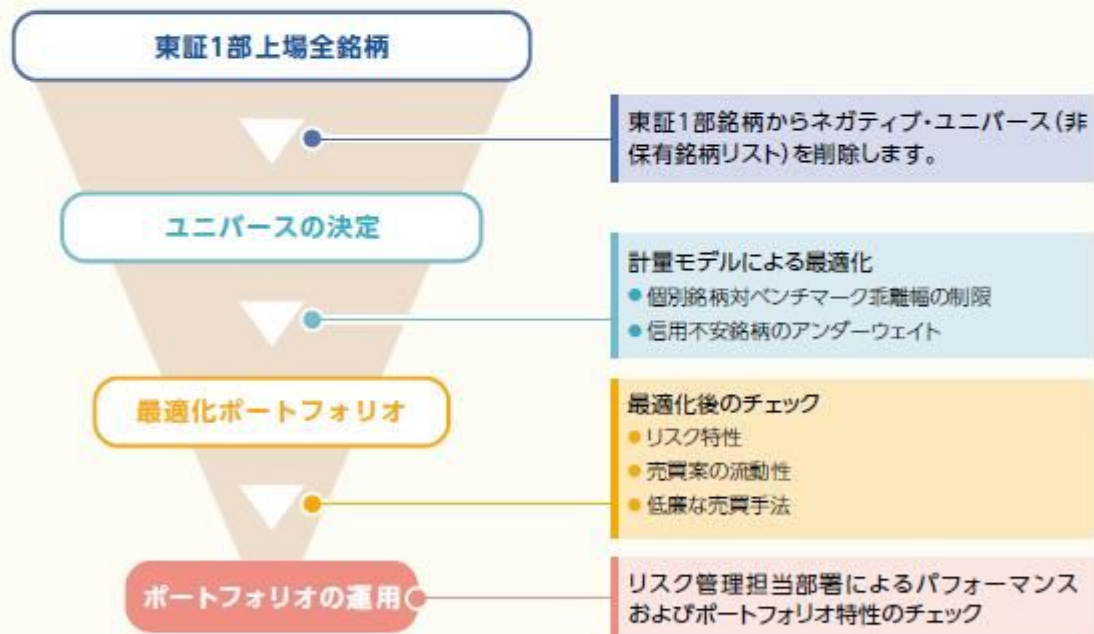
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

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

□ 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。

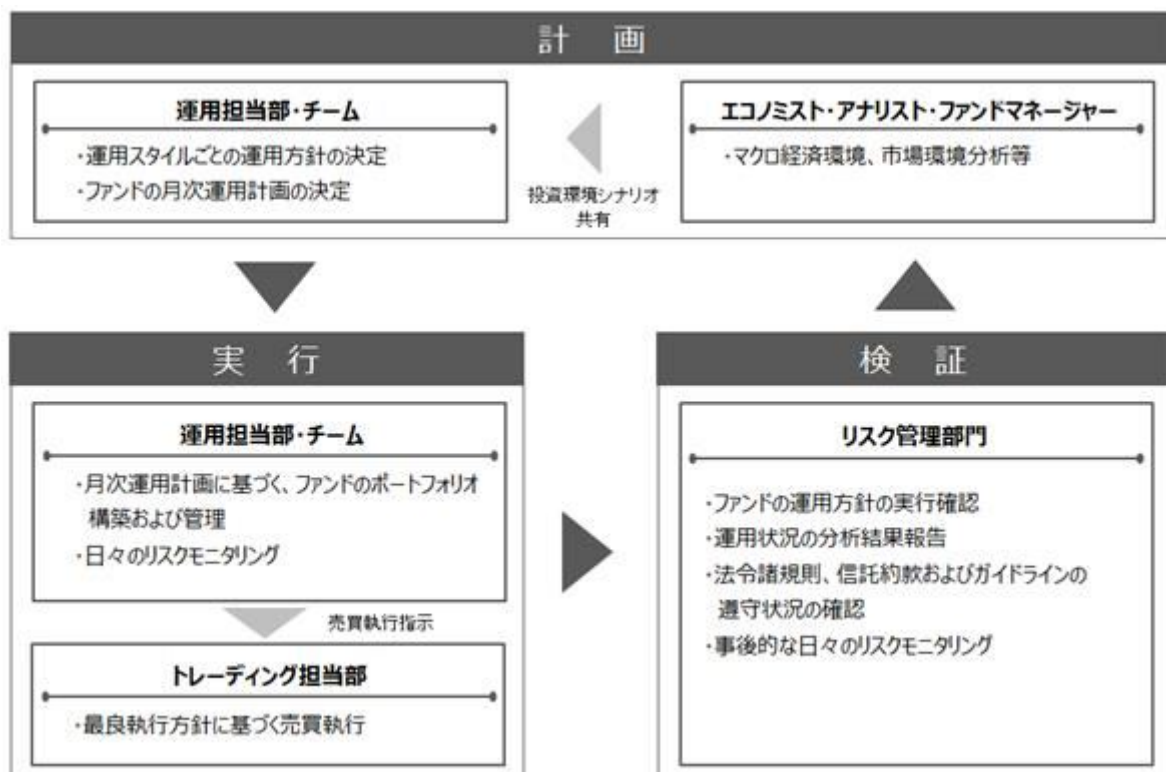
八 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記□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。

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

(4)【配分方針】

年1回(原則として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配分金額を決定します。

- 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。
- 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】

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。
- 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。

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。
- 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

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。

八 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るときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

二 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。

法令に基づく投資制限

- イ 同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

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

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

(参考情報:国内株式インデックス・マザーファンド(B号)の投資方針等)

(1)投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

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

(2)投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

資本金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入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

(ヘ) 換金制限等に関する留意点

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

(ト) 収益分配金に関する留意事項

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



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

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額

の値上がりが小さかった場合も同様です。

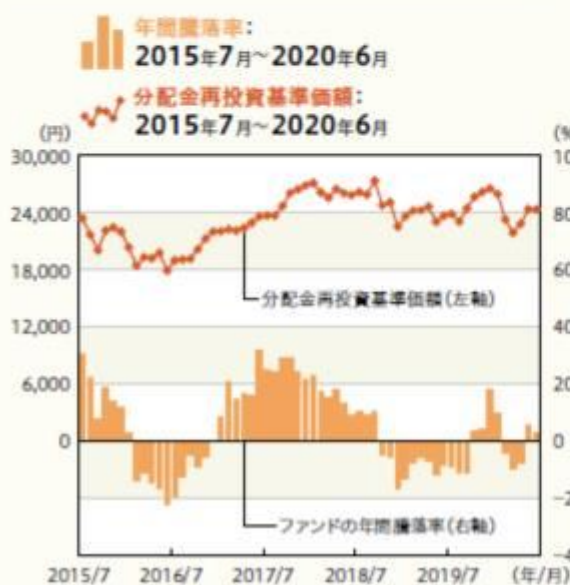
□ 投資リスクの管理体制

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。



※年騰落率、分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算したものです。
※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕

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



※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。
※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(配当込み) 株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NO-MURA-BPI(国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが開発した指数で、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財産その他の権利は、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は、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

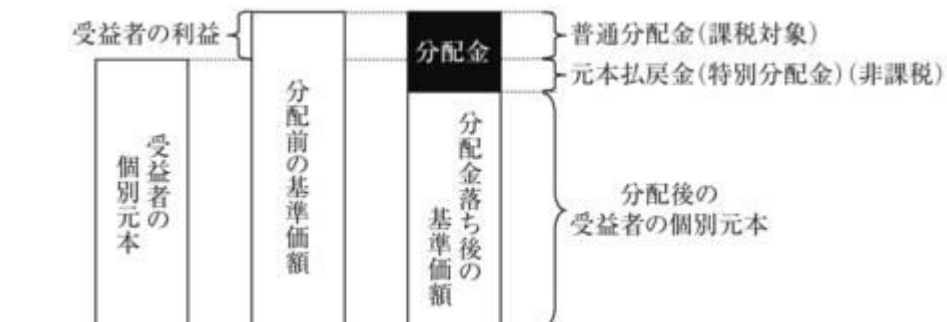
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・ 収益分配時

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

・ 一部解約時および償還時

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

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

(ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。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）

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、2020年6月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

5【運用状況】

(1)【投資状況】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

2020年 6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	25,158,349,493	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,364,892	0.02
合計(純資産総額)		25,152,984,601	100.00

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

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

イ 主要投資銘柄

2020年 6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)	9,955,816,974	2.7170	27,050,265,592	2.5270	25,158,349,493	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

2020年 6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

【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。

【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】

【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
2019年 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	
2020年 1月末日	26,914,932,849		25,975	
2月末日	23,924,720,164		23,301	
3月末日	22,802,769,512		21,912	
4月末日	23,641,982,345		22,854	
5月末日	25,457,528,412		24,406	
6月末日	25,152,984,601		24,359	

【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

【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
第18期(中間期)	6.2

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

(4) 【設定及び解約の実績】

三井住友・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
第18期(中間期)	1,520,754,335	1,538,626,746

(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)

2020年 6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	160,728,307,970	97.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,815,645,469	2.32
合計(純資産総額)		164,543,953,439	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	3,693,645,000	2.24
合計	買建		3,693,645,000	2.24

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2020年 6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	819,700	7,612.43	6,239,908,885	6,762.00	5,542,811,400	3.37
日本	株式	ソニー	電気機器	460,300	6,915.41	3,183,165,068	7,384.00	3,398,855,200	2.07
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	572,300	4,202.00	2,404,805,952	5,450.00	3,119,035,000	1.90
日本	株式	キーエンス	電気機器	66,600	37,434.60	2,493,144,704	45,030.00	2,998,998,000	1.82

日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	963,100	2,758.44	2,656,661,683	2,515.50	2,422,678,050	1.47
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	611,500	4,380.26	2,678,530,343	3,848.00	2,353,052,000	1.43
日本	株式	任天堂	その他製品	45,100	42,596.27	1,921,091,840	48,010.00	2,165,251,000	1.32
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,958,800	566.40	2,808,686,784	421.60	2,090,630,080	1.27
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	503,100	3,893.75	1,958,950,405	3,682.00	1,852,414,200	1.13
日本	株式	第一三共	医薬品	210,200	6,929.80	1,456,645,631	8,806.00	1,851,021,200	1.12
日本	株式	KDDI	情報・通信業	526,500	3,130.79	1,648,360,935	3,234.00	1,702,701,000	1.03
日本	株式	ダイキン工業	機械	93,600	15,505.57	1,451,321,397	17,335.00	1,622,556,000	0.99
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	578,200	3,038.93	1,757,110,456	2,755.50	1,593,230,100	0.97
日本	株式	信越化学工業	化学	123,500	11,727.76	1,448,378,702	12,595.00	1,555,482,500	0.95
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	501,500	3,894.97	1,953,331,285	3,032.00	1,520,548,000	0.92
日本	株式	花王	化学	176,000	8,620.53	1,517,214,303	8,540.00	1,503,040,000	0.91
日本	株式	HOYA	精密機器	145,900	9,923.79	1,447,880,961	10,260.00	1,496,934,000	0.91
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	515,100	3,001.75	1,546,202,868	2,882.00	1,484,518,200	0.90
日本	株式	村田製作所	電気機器	215,800	6,400.99	1,381,334,565	6,316.00	1,362,992,800	0.83
日本	株式	ファナック	電気機器	69,200	20,658.72	1,429,583,424	19,260.00	1,332,792,000	0.81
日本	株式	中外製薬	医薬品	229,500	3,314.90	760,771,480	5,765.00	1,323,067,500	0.80
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,843,900	165.11	1,625,387,853	132.20	1,301,363,580	0.79
日本	株式	日本電産	電気機器	176,900	7,956.31	1,407,472,480	7,196.00	1,272,972,400	0.77
日本	株式	S M C	機械	23,000	49,111.60	1,129,566,958	55,180.00	1,269,140,000	0.77
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	46,600	22,297.58	1,039,067,654	26,440.00	1,232,104,000	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	255,700	5,889.60	1,505,972,372	4,698.00	1,201,278,600	0.73
日本	株式	日立製作所	電気機器	353,000	4,192.42	1,479,925,372	3,403.00	1,201,259,000	0.73
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	505,500	2,407.97	1,217,231,808	2,321.50	1,173,518,250	0.71
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	637,100	1,867.04	1,189,494,260	1,799.50	1,146,461,450	0.70
日本	株式	三菱商事	卸売業	474,700	2,854.92	1,355,230,524	2,270.00	1,077,569,000	0.65

□ 種類別・業種別の投資比率

2020年 6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	0.09
		鉱業	0.19
		建設業	2.53
		食料品	3.85
		繊維製品	0.49
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.14
		医薬品	6.74
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.61

	ガラス・土石製品	0.75
	鉄鋼	0.55
	非鉄金属	0.67
	金属製品	0.53
	機械	5.16
	電気機器	14.76
	輸送用機器	7.11
	精密機器	2.58
	その他製品	2.44
	電気・ガス業	1.52
	陸運業	3.92
	海運業	0.13
	空運業	0.34
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	9.73
	卸売業	4.37
	小売業	4.87
	銀行業	4.83
	証券、商品先物取引業	0.77
	保険業	1.95
	その他金融業	1.11
	不動産業	1.97
	サービス業	5.16
合計		97.68

投資不動産物件

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

2020年 6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	237	日本円	3,806,318,100	3,693,645,000	2.24

（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:2020年6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	97.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2.32
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 2.24%

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	3.37
日本	株式	ソニー	電気機器	2.07
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.90
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.82
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.47
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1.43
日本	株式	任天堂	その他製品	1.32
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.27
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1.13
日本	株式	第一三共	医薬品	1.12

※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)」は購入有価証券が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)



※2020年の収益率は、年初から2020年6月30日までの騰落率を表示しています。

※ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

1【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

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

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

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

ロ 申込価額

取得申込受付日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

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	コールセンター	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（コールセンター：0120-88-2976）にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）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	コールセンター	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、受託会社は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があるため、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て)に支払われます。
- ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更

- (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。

二 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、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でも、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。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

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

<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関する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(2018年12月 1日から2019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		第17期	
	自	平成29年12月 1日 至 平成30年11月30日	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	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>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。</p>	

（ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第16期		第17期	
	（平成30年11月30日現在）		（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	第17期
	自 平成29年12月 1日 至 平成30年11月30日	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)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第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	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、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。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

項目	第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	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用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。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、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。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第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】

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	

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

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年11月30日現在）	（令和 1年12月 2日現在）
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 2,721,200,000円</p>	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,095,200,000円</p>
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	<p>1口当たり純資産額 2.5937円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 25,937円)</p>	<p>1口当たり純資産額 2.7359円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 27,359円)</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成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	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する会議をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用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。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する会議にて、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。</p>

4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。
---------------------------	--

・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		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,738,480,360	-	4,870,560,000	132,079,640
	東証株価指数先物	4,738,480,360	-	4,870,560,000	132,079,640
合計		4,738,480,360	-	4,870,560,000	132,079,640

（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		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				

買建	3,926,928,600	-	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
S M A M ・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	180,714,188円
三井住友・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(T O P I X)	1,987,526,237円
三井住友・DCつみたてN I S A ・日本株インデックスファンド	7,498,073,954円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	443,898,286円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	618,202,967円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	611,775,561円

三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	8,569,755円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	9,514,881円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	10,918,100円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	39,419,537円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	28,365,827円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	63,515,584円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	5,621,357円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	5,957,306,958円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	24,723,073円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉	514,312,458円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	3,486,172,970円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	2,450,832,018円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	9,016,678,236円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	57,327,222円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	223,654,156円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	758,842円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	978,965,161円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型〈適格機関投資家限定〉	55,007,822円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	384,921,677円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	1,118,064,318円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	928,739,841円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	3,098,232,570円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,510,156円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,207,656,106円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	64,109,227円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	85,263,426円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,640,032,255円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	106,297,419円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	48,499,056円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	22,363,154円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	211,902,924円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	386,107,457円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	169,452,674円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	120,236,114円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	60,898,000円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	11,117,259円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉	78,033,493円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉	973,799,546円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	202,412,662円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2〈適格機関投資家専用〉	19,535,802円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA〈適格機関投資家限定〉	1,677,781,097円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA〈適格機関投資家限定〉	232,095,874円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	1,575,906,619円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	133,573,058円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド〈適格機関投資家限定〉	8,319,114円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04〈適格機関投資家限定〉	73,059,305円

S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	35,005,032円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	86,203,195円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	20,774円
合計	66,912,228,971円

(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
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	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(T O P I X)	1,522,887,951円
三井住友・DCつみたてN I S A ・日本株インデックスファンド	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N I S A ・世界分散ファンド	12,899,750円
三井住友D S ・国内株式インデックス年金ファンド	407,382円
三井住友D S ・年金バランス30(債券重点型)	77,860円
三井住友D S ・年金バランス50(標準型)	137,846円
三井住友D S ・年金バランス70(株式重点型)	198,857円
S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,810,058,037円
バランスファンドV A (安定運用型)<適格機関投資家限定>	22,375,907円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型<適格機関投資家限定>	218,475,561円

S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	3,018,643,305円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	2,309,967,382円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	8,366,581,213円
S M A M ・ バランスファンドV L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	55,996,005円
S M A M ・ バランスファンドV L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	212,637,976円
世界6資産バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	794,882円
S M A M ・ バランスファンドV A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	882,312,334円
S M A M ・ バランスファンドV L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	55,058,558円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	363,346,655円
S M A M ・ インデックス・バランスV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,058,492,761円
S M A M ・ バランスファンドV A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	861,659,534円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	2,778,991,517円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,137,750円
S M A M ・ グローバルバランス4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	58,214,802円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	71,457,145円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	44,386,681円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	21,663,542円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	179,161,011円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	345,072,882円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	11,140,518円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	111,594,783円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	58,092,653円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	9,215,706円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	70,883,973円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	848,254,810円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・ V A (適格機関投資家専用)	194,795,060円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	19,380,760円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,164,508,623円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	193,275,461円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,504,949,363円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	111,253,748円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	14,465,450円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	81,986,207円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・ オープン < 適格機関投資家限定 >	51,058,228円
S M A M ・ マルチアセット・ ダイナミックアロケーション・ ストラテジー・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	307,740,440円
合計	63,743,430,458円

附属明細表

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	
ピ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	
銭高組	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	
浅沼組	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
N I P P O	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
大気社	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
O S J B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	
キューピー	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	
ゲンゼ	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
T S I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
東亜合成	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
日本パーカライズング	35,400	1,167.00	41,311,800
高压ガス工業	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
J S R	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
K H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
A D E K A	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
D I C	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S Cホールディングス	13,900	2,681.00	37,265,900
T & K T O K A	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
J C U	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
J S P	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

大太平洋金属	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
D O W A 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
U A C J	10,700	2,487.00	26,610,900
C K 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C o	4,300	1,311.00	5,637,300
S U M C O	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
R S 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
文化シャッター	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
L I X I L 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
F U J I	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
D M G 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
フリーー	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
S M C	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
T O W A	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
C K D	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
S A N K Y O	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
J U K I	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
T P R	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
N T N	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
T H K	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

I H I	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
J V C 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
I D E C	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
E I Z O	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
T D K	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
S M K	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
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
エスベック	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
オブテックスグループ	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
ハリオス 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

SCREEN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	
K Y B	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
S U B A R U	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
T B K	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
J M S	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
ビジョン	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
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
N E C ネットズエスアイ	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
ソフトクリエイティブホールディングス	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
ポルトウウィン・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
C A R T A H O L D I N G S	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
S H I F T	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
G M O 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
G M O クラウド	1,800	2,917.00	5,250,600
S R A ホールディングス	4,400	2,546.00	11,202,400

e B A S E	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
g u m i	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
U b i c o mホールディングス	2,300	1,259.00	2,895,700
L I N E	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
A O I T Y O H o l d i n g s	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
T D C 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
I D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
C A C 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
ソフトブレイン	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
E M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
I M A G I C A 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
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
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
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
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
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
T O K Y O B A S E	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
L I X I L 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
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
グルメ軒屋	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
サクスパー ホールディングス	8,300	905.00	7,511,500
ペルーナ	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U F J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
N E C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
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
L I F U L L	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
G C A	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
総合警備保障	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
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	
I B J	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йка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。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【中間財務諸表】

- 1 . 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 . 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期中間計算期間(2019年12月3日から2020年 6月 2日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【三井住友・日本株式インデックス年金ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第18期中間計算期間 (2020年 6月 2日現在)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	31,981,815
コール・ローン	25,052,031
親投資信託受益証券	25,863,982,034
未収入金	19,640,280
流動資産合計	25,940,656,160
資産合計	25,940,656,160
負債の部	
流動負債	
未払解約金	76,671,766
未払受託者報酬	5,504,444
未払委託者報酬	28,898,276
未払利息	67
その他未払費用	14,640
流動負債合計	111,089,193
負債合計	111,089,193
純資産の部	
元本等	
元本	10,422,786,382
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	15,406,780,585
元本等合計	25,829,566,967
純資産合計	25,829,566,967
負債純資産合計	25,940,656,160

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第18期中間計算期間 自 2019年12月 3日 至 2020年 6月 2日
営業収益	
有価証券売買等損益	1,613,006,050
営業収益合計	1,613,006,050
営業費用	
支払利息	8,884
受託者報酬	5,504,444
委託者報酬	28,898,276
その他費用	23,470
営業費用合計	34,435,074
営業利益又は営業損失()	1,647,441,124
経常利益又は経常損失()	1,647,441,124
中間純利益又は中間純損失()	1,647,441,124
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	381,827,193
期首剰余金又は期首欠損金()	17,139,715,002
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,038,958,534
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,038,958,534
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,506,279,020
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,506,279,020
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	15,406,780,585

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第18期中間計算期間 自 2019年12月 3日 至 2020年 6月 2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当中間計算期間は前期末が休日のため、2019年12月 3日から2020年 6月 2日までとなっております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第18期中間計算期間 (2020年 6月 2日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	10,422,786,382口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.4782円
	(10,000口当たりの純資産額 24,782円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第18期中間計算期間 (2020年 6月 2日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第18期中間計算期間 (2020年 6月 2日現在)
期首元本額	10,440,658,793円
期中追加設定元本額	1,520,754,335円
期中一部解約元本額	1,538,626,746円

(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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

貸借対照表

(単位:円)

(2020年 6月 2日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	1,292,090,641
コール・ローン	1,011,411,004
株式	164,278,122,420
派生商品評価勘定	116,178,200
未収入金	1,193,202,874

(2020年 6月 2日現在)

未収配当金	1,644,335,716
流動資産合計	169,535,340,855
資産合計	169,535,340,855
負債の部	
流動負債	
前受金	116,220,000
未払金	1,630,000
未払解約金	1,499,678,445
未払利息	2,745
その他未払費用	95,386
流動負債合計	1,617,626,576
負債合計	1,617,626,576
純資産の部	
元本等	
元本	65,328,920,360
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	102,588,793,919
元本等合計	167,917,714,279
純資産合計	167,917,714,279
負債純資産合計	169,535,340,855

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 2019年12月 3日 至 2020年 6月 2日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（2020年 6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。	
	株式	2,709,600,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		65,328,920,360口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.5703円
	(10,000口当たりの純資産額)	25,703円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（2020年 6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、新株予約権証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（2020年 6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		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,076,706,800	-	3,192,885,000	116,178,200
	東証株価指数先物	3,076,706,800	-	3,192,885,000	116,178,200
合計		3,076,706,800	-	3,192,885,000	116,178,200

（注）1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(2020年 6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	63,743,430,458円
同期中における追加設定元本額	11,158,855,110円
同期中における一部解約元本額	9,573,365,208円
2020年 6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	10,062,631,613円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	960,726,765円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,537,936,572円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,170,799,242円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	106,819,830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)	6,837,722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)	24,729,887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)	67,685,096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)	126,319,500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)	88,510,769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)	184,996,756円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,657,555,012円
三井住友・DCつみたてN I S A ・日本株インデックスファンド	13,432,998,847円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	332,556,353円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	388,449,651円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	288,550,166円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2050	15,220,117円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	91,200,596円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	73,419,099円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	230,098,091円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	113,450,040円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	141,851,444円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	17,868,308円
三井住友D S ・ 国内株式インデックス年金ファンド	54,513,512円
三井住友D S ・ 年金バランス30(債券重点型)	2,295,992円
三井住友D S ・ 年金バランス50(標準型)	14,866,955円
三井住友D S ・ 年金バランス70(株式重点型)	9,733,698円
三井住友D S ・ DCターゲットイヤーファンド2060	2,713,227円
S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,757,743,062円
バランスファンドV A (安定運用型) <適格機関投資家限定>	20,497,567円
S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型 <適格機関投資家限定>	213,914,423円
S M A M ・ バランスファンドV A 25 <適格機関投資家専用>	3,050,202,701円

SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	2,316,045,497円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	8,500,815,157円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	55,018,204円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	212,537,259円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	563,260円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	883,234,047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>	56,938,376円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	363,057,680円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,054,299,248円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	882,883,607円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	2,788,114,411円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	828,613円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	59,510,264円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	74,472,086円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	44,547,485円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	22,203,055円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	185,623,518円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	368,552,703円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	105,838,575円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	52,693,701円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,589,272円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	68,157,923円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	899,807,367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)	190,637,627円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	18,815,776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>	836,514,765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>	185,626,359円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,522,610,228円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	112,200,588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>	13,270,330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>	26,312,587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>	33,090,663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>	136,817,516円
合計	65,328,920,360円

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

2020年 6月30日現在

資産総額	25,197,022,128円
負債総額	44,037,527円
純資産総額（ - ）	25,152,984,601円
発行済口数	10,326,082,167口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4359円
（1万口当たり純資産額）	（24,359円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

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

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

へ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	2020年6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。

八 会社の機構

委託会社の取締役は8名以内とし、株主総会で選任されます。取締役の選任決議は、議決権を行使することができる株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。

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

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名を選定することができます。

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

2020年6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	744	7,367,544
単体型株式投資信託	124	592,384
追加型公社債投資信託	1	28,659
単体型公社債投資信託	182	451,225
合計	1,051	8,439,814

3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、当事業年度（2019年4月1日から2020年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,755,961	33,264,545
顧客分別金信託	20,011	300,021
前払費用	476,456	515,226
未収入金	64,856	602,605
未収委託者報酬	6,963,077	8,404,880
未収運用受託報酬	1,129,548	2,199,785
未収投資助言報酬	285,668	299,826
未収収益	44,150	37,702
その他の流動資産	31,771	40,119
流動資産合計	22,771,504	45,664,712
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	173,517	101,609
器具備品	751,471	783,224

土地	-	710
リース資産	-	968
建設仮勘定	-	66,498
有形固定資産合計	924,988	953,010
無形固定資産		
ソフトウェア	479,867	909,133
ソフトウェア仮勘定	183,528	508,733
のれん	-	34,397,824
顧客関連資産	-	17,785,166
電話加入権	44	12,739
商標権	60	54
無形固定資産合計	663,501	53,613,651
投資その他の資産		
投資有価証券	10,829,628	19,436,480
関係会社株式	10,252,067	11,246,398
長期差入保証金	2,004,451	2,523,637
長期前払費用	97,107	113,852
会員権	7,819	90,479
繰延税金資産	1,426,381	-
貸倒引当金	-	20,750
投資その他の資産合計	24,617,457	33,390,098
固定資産合計	26,205,946	87,956,760
資産合計	48,977,450	133,621,473

(単位：千円)

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	4,534	14,285
その他の預り金	1,480,229	146,200
未払金		
未払収益分配金	1,122	1,629
未払償還金	137,522	131,338
未払手数料	3,246,133	3,776,873
その他未払金	768,373	502,211
リース債務	-	1,064
未払費用	3,535,589	3,935,582
未払消費税等	84,966	305,513
未払法人税等	670,761	489,151
賞与引当金	1,302,052	1,716,321
その他の流動負債	18,110	30,951
流動負債合計	11,249,395	11,051,125
固定負債		
退職給付引当金	3,418,601	5,299,814
賞与引当金	5,074	14,767
繰延税金負債	-	2,963,538
その他の固定負債	5,074	172,918
固定負債合計	3,428,751	8,451,038
負債合計	14,678,146	19,502,164
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
その他資本剰余金	-	81,927,000
資本剰余金合計	8,628,984	90,555,984
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	21,255,054	19,364,265
利益剰余金合計	23,076,258	21,185,470
株主資本計	33,705,242	113,741,454
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	594,061	377,855
評価・換算差額等合計	594,061	377,855
純資産合計	34,299,304	114,119,309
負債・純資産合計	48,977,450	133,621,473

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	39,156,499	54,615,133
運用受託報酬	6,277,217	9,389,058
投資助言報酬	1,332,888	1,303,595
その他営業収益		
サービス支助手数料	182,502	181,061
その他	49,507	32,421
営業収益計	46,998,614	65,521,269
営業費用		
支払手数料	18,499,433	24,888,040
広告宣伝費	361,696	447,024
公告費	125	-
調査費		
調査費	1,752,905	3,214,679
委託調査費	6,050,441	7,702,309
営業雑経費		
通信費	46,551	70,007
印刷費	338,465	612,249
協会費	24,700	45,117
諸会費	23,756	32,199
情報機器関連費	2,872,416	4,349,174
販売促進費	49,118	68,688
その他	148,307	154,201
営業費用合計	30,167,918	41,583,691
一般管理費		
給料		
役員報酬	190,951	264,325
給料・手当	6,308,066	9,789,691
賞与	514,259	914,702
賞与引当金繰入額	1,235,936	1,726,013
交際費	27,802	30,898
寄付金	82	2,022

事務委託費	286,905	956,931
旅費交通費	228,538	249,359
租税公課	285,369	389,032
不動産賃借料	612,410	1,121,553
退職給付費用	463,553	797,158
固定資産減価償却費	378,530	3,044,658
のれん償却費	-	2,645,986
諸経費	290,243	482,324
一般管理費合計	10,822,651	22,414,658
営業利益	6,008,044	1,522,919

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	-	778,113
受取利息	623	947
時効成立分配金・償還金	72	1,041
原稿・講演料	1,951	2,061
投資有価証券償還益	289,451	6,398
投資有価証券売却益	7,247	24,206
雑収入	36,408	53,484
営業外収益合計	335,754	866,254
営業外費用		
為替差損	15,760	72,457
投資有価証券償還損	13,668	129,006
投資有価証券売却損	14,605	12,906
雑損失	7,027	8,334
営業外費用合計	51,061	222,704
経常利益	6,292,738	2,166,469
特別利益		
過去勤務費用償却益	79,850	-
特別利益合計	79,850	
特別損失		
固定資産除却損	1 1,462	110,668
関係会社株式評価損	160,455	-
合併関連費用	2 187,140	42,800
本社移転費用	3 -	133,168
減損損失	4 -	46,417
特別損失合計	349,058	333,054
税引前当期純利益	6,023,530	1,833,414
法人税、住民税及び事業税	1,750,031	1,874,278
法人税等調整額	90,084	619,676
法人税等合計	1,840,116	1,254,602
当期純利益	4,183,413	578,811

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

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

	株主資本		評価・換算差額等		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

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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	その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金		
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金	
当期首残高	2,000,000	8,628,984	-	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,255,054
当期変動額								
剰余金の配当								2,469,600
当期純利益								578,811
合併による増加			81,927,000	81,927,000				
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）								
当期変動額合計	-	-	81,927,000	81,927,000	-	-	-	1,890,788
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265

	株主資本		評価・換算差額等	
	利益剰余金			

	利益剰余金 合計	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当期変動額					
剰余金の配当	2,469,600	2,469,600			2,469,600
当期純利益	578,811	578,811			578,811
合併による増加		81,927,000			81,927,000
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			216,206	216,206	216,206
当期変動額合計	1,890,788	80,036,211	216,206	216,206	79,820,005
当期末残高	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309

[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

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（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2016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	3～15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、当事業年度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計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(表示方法の変更)

前事業年度において「特別利益」に含めていた「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」を「営業外収益」として、「特別損失」に含めていた「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」を「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、当事業年度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。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「特別利益」の「投資有価証券売却益」及び「投資有価証券償還益」に表示していた7,247千円及び289,451千円は「営業外収益」として、「特別損失」の「投資有価証券売却損」及び「投資有価証券償還損」に表示していた14,605千円及び13,668千円は「営業外費用」として組み替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
建物	350,176千円	466,875千円
器具備品	922,553千円	1,225,261千円
リース資産	-千円	1,452千円

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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020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 DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	174,854千円	132,559千円

(損益計算書関係)

1 固定資産除却損

	前事業年度 (自2018年4月1日 至2019年3月31日)	当事業年度 (自2019年4月1日 至2020年3月31日)
建物	-千円	879千円
器具備品	695千円	119千円
リース資産	-千円	5,377千円
ソフトウェア	766千円	1,596千円
ソフトウェア仮勘定	-千円	102,695千円

2 合併関連費用

前事業年度の合併関連費用は、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。

当事業年度の合併関連費用は、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及び海外現地法人の統合に関する弁護士費用であります。

3 本社移転費用

本社移転費用は、本社事務所移転に伴い解約日までに賃貸期間の残存分(2020年7月13日から2020年9月30日まで)の賃料及び共益費相当額として133,168千円支払うものであります。

4 減損損失

当社は以下のとおり減損損失を計上しております。

(単位:千円)

場所	用途	種類	減損損失
千代田区	事業用資産	建物	46,417

当社は、資産と対応して継続的に収支の把握ができる単位が全社のみであることから全社資産の単一グループとしております。

上記事業用資産については、霞ヶ関オフィスの移転に係る意思決定をしたことに伴い将来の使用が見込めなくなった資産につき、回収可能額を零と見積もり、当該減少額を減損損失に計上しております。その内訳は、建物に計上した資産除去債務に対応する原状回復費用相当額であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	17,622,360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2018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2018年11月1日を効力発生日としておりますので、2019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
2018年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000.00	2018年 3月31日	2018年 6月27日
2019年2月28日 臨時株主総会	普通株式	6,667,038	377.95	2019年 1月31日	2019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

2019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
2019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	2019年 3月28日	2019年 6月25日

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

合併に伴う普通株式の発行により16,230,060株増加しております。

	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	17,640,000株	16,230,060株	-	33,870,060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
2019年6月24日 臨時株主総会	普通株式	2,469,600	140.00	2019年 3月28日	2019年 6月25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

2020年6月29日開催の第35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
2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	711,271	21.00	2020年 3月31日	2020年 6月30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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
1年以内	597,239	1,618,641
1年超	6,115,662	5,844,934
合計	6,712,901	7,463,576

(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であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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

市場リスクの管理

投資有価証券については、自己勘定資産の運用・管理に関する規程に従い、各所管部においては所管する有価証券について管理を、経営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、次表には含まれていません（（注2）参照）。

前事業年度（2019年3月31日）

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
----	----------	----	----

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

当事業年度(2020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	33,264,545	33,264,545	-
(2)顧客分別金信託	300,021	300,021	-
(3)未収委託者報酬	8,404,880	8,404,880	-
(4)未収運用受託報酬	2,199,785	2,199,785	-
(5)未収投資助言報酬	299,826	299,826	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	19,391,111	19,391,111	-
(7)長期差入保証金	2,523,637	2,523,637	-
資産計	66,383,807	66,383,807	-
(1)顧客からの預り金	14,285	14,285	-
(2)未払手数料	3,776,873	3,776,873	-
負債計	3,791,158	3,791,158	-

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	298	45,369
合計	298	45,369
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,252,067	11,246,398
合計	10,252,067	11,246,398

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(2019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	-	-

当事業年度(2020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	33,264,545	-	-	-
顧客分別金信託	300,021	-	-	-
未収委託者報酬	8,404,880	-	-	-
未収運用受託報酬	2,199,785	-	-	-
未収投資助言報酬	299,826	-	-	-
長期差入保証金	1,125,292	1,398,345	-	-
合計	45,594,350	1,398,345	-	-

(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(2019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。

当事業年度(2020年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式11,246,398千円)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(2019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。

当事業年度(2020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	12,411,812	13,327,652	915,839
小計	12,411,812	13,327,652	915,839
(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	6,413,317	6,063,458	349,858
小計	6,413,317	6,063,458	349,858
合計	18,825,130	19,391,111	565,980

(注) 非上場株式等(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。

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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
---------	-------	--------

(単位：千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
1,578,762	289,451	13,668

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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
1,814,360	24,206	12,906

(単位：千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
3,631,425	6,398	129,006

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,319,830	3,418,601
勤務費用	267,362	523,396
利息費用	-	-
数理計算上の差異の発生額	3,658	195
退職給付の支払額	85,082	349,050
過去勤務費用の発生額	79,850	-
合併による発生額	-	1,707,062
退職給付債務の期末残高	3,418,601	5,299,814

(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 (2019年3月31日)	当事業年度 (2020年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,418,601	5,299,814
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	3,418,601	5,299,814

(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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
勤務費用	267,362	492,511
利息費用	-	-
数理計算上の差異の費用処理額	3,658	195
過去勤務費用償却益	79,850	-
その他	199,849	304,842

確定給付制度に係る退職給付費用	383,703	797,158
-----------------	---------	---------

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

(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 2018年 4月 1日 至 2019年 3月 31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020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156,457千円、当事業年度248,932千円であります。

(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原因別の内訳

	(単位:千円)	
	前事業年度 (2019年 3月 31日)	当事業年度 (2020年 3月 31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,046,775	1,622,803
賞与引当金	400,242	530,059
調査費	80,983	178,573
未払金	57,192	162,557
未払事業税	54,797	46,423
ソフトウェア償却	17,501	91,937
子会社株式評価損	50,580	114,876
その他有価証券評価差額金	-	150,771
その他	32,218	88,250
繰延税金資産小計	1,740,292	2,986,254
評価性引当額(注)	51,729	193,485
繰延税金資産合計	1,688,563	2,792,768
繰延税金負債		
無形固定資産	-	5,445,817
その他有価証券評価差額金	262,181	310,488
繰延税金負債合計	262,181	5,756,306
繰延税金資産(負債)の純額	1,426,381	2,963,538

(注) 評価性引当額が141,756千円増加しております。この増加の内容は、主として大和住銀投信投資顧問株式会社との合併によるものであります。

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 (2019年 3月 31日)	当事業年度 (2020年 3月 31日)
法定実効税率	30.6%	30.6%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.8	3.5
受取配当等永久に益金に算入されない項目	-	13.9
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.9	7.3
住民税均等割等	0.1	0.5
所得税額控除による税額控除	1.4	0.5
のれん償却費	-	44.1

その他	0.4	3.3
税効果会計適用後の法人税等の負担率	30.5	68.4

(セグメント情報等)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至2020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	54,615,133	9,389,058	1,303,595	213,482	65,521,269

(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

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。

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。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,499,836	未払 手数料	399,447
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,789,062	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)

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社の子会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,703,669	未払 手数料	644,246
親会社の子会社	SMBC日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	%	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	6,265,593	未払 手数料	890,935

(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 2018年 4月 1日 至 2019年 3月31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)
1株当たり純資産額	1,944.40円	3,369.33円
1株当たり当期純利益金額	237.15円	17.09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いません。
 2. 当社は、2018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。
 1株当たり情報については、当該株式分割を2019年3月期の期首(2018年4月1日)に行ったものと仮定して、
 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 2018年 4月 1日 至 2019年 3月31日)	当事業年度 (自 2019年 4月 1日 至 2020年 3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	4,183,413	578,811
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)	4,183,413	578,811
期中平均株式数(株)	17,640,000	33,870,060

(企業結合等関係)

(取得による企業結合)

当社は、2018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、2019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

2019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 2019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 2019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. 財務諸表に含まれている被取得企業の業績の期間

2019年4月1日から2020年3月31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

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

(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。

- 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。
- 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。
- 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
役員退職慰勞引当金	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	繰越利益剰余金
				別途積立金		
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 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。</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。 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。</p> <p>(2) 無形固定資産（リース資産を除く） 定額法を採用しております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。</p> <p>(3) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リース取引に係るリース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>
<p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金 債権の貸倒による損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等の特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(3) 役員賞与引当金 役員賞与の支払に備えるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、社内規定に基づく当事業年度末の要支給額を計上しております。 これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績に応じて、各事業年度ごとに各人別に勤務費用が確定するためです。</p> <p>(5) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支払に備えるため、役員退職慰労金規程に基づき事業年度末における要支給額を計上しております。</p>

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S M A Mとの合併に関する業務委託費用であります。

(株主資本等変動計算書関係)

第46期(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	配当の 原資	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
----	-------	----------------	-----------	---------------------	-----	-------

平成30年6月22日 定時株主総会	普通 株式	2,348,500	利益 剰余金	610	平成30年3月31日	平成30年6月23日
----------------------	----------	-----------	-----------	-----	------------	------------

第47期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

安全性の高い金融商品での短期的な運用の他に、自社ファンドの設定に自己資本を投入しております。

その自己設定投信は、事業推進目的で保有しており、設定、解約又は償還に関しては、社内規定に従っております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

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

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

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

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

これらの債務は、全て1年以内の債務であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行等に係るリスク）の管理

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

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

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

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

なお、デリバティブ取引については行っておりません。

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

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

2.金融商品の時価等に関する事項

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

第46期（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）金融商品に該当するものを表示しております。

第47期（平成31年3月31日）

（単位：千円）

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

（*）金融商品に該当するものを表示しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

- (5) 投資有価証券

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

- (6) 長期差入保証金

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

負債

(1) 未払手数料、及び(2) 未払費用

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

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

(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) 其他有価証券 非上場株式	51,135	45,071
(2) 子会社株式 非上場株式	956,115	956,115
(3) 長期差入保証金	534,699	9,677

これらについては、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから時価開示の対象としておりません。このため、(1) 其他有価証券の非上場株式については2.(5) 投資有価証券には含めておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日以後の償還予定額

第46期（平成30年3月31日）

(単位：千円)

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

第47期（平成31年3月31日）

(単位：千円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式

第46期（平成30年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

第47期（平成31年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額、関係会社株式 956,115千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. 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	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

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 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 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 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 料	228,197

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(1株当たり情報)

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

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

1株当たりの当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第46期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)	第47期 (自平成30年4月1日 至平成31年3月31日)
当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益(千円)	4,700,218	2,933,531
普通株式の期中平均株式数(千株)	3,850	3,850

(重要な後発事象)

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

4【利害関係人との取引制限】

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

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常の実行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

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

該当ありません。

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(2020年3月末現在)

(ハ) 事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 株式会社日本カストディ銀行*
- ・ 資本金の額 51,000百万円(2020年7月27日現在)
- ・ 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。

*株式会社日本カストディ銀行は、2020年7月27日に日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社、資産管理サービス信託銀行株式会社およびJTCホールディングス株式会社が合併して発足しました。

ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
S M B C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、2020年3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【その他】

1 目論見書の表紙から本文の前までおよび裏表紙の記載について

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

(2)委託会社の金融商品取引業者登録番号を記載することがあります。

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

(4)請求目論見書の入手方法および投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨を記載することがあります。

(5)目論見書の使用開始日を記載することがあります。

(6)投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。

- (7) 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨を記載することがあります。
 - (8) 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載をすることがあります。
 - (9) 当ファンドのロゴおよび委託会社のロゴを記載することがあります。
 - (10) ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマークを記載することがあります。
 - (11) 写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用することがあります。また、ファンドの管理番号等を記載することがあります。
- 2 目論見書は電子媒体等として使用される他、インターネット等に掲載されることがあります。
 - 3 当ファンドの投資信託約款の全文を請求目論見書に掲載することがあります。
 - 4 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書(交付目論見書)」または「投資信託説明書(請求目論見書)」と称して使用することがあります。
 - 5 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
 - 6 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書(交付目論見書)で説明することがあります。また、有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)および投資信託説明書(請求目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年6月15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

東京事務所

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**監査意見**

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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35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。

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の2020年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績の状況を、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による

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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

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

2020年7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	菅野 雅子 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	松井 貴志 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2019年12月3日から2020年6月2日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友・日本株式インデックス年金ファンドの2020年6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中間計算期間（2019年12月3日から2020年6月2日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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