

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年2月24日提出
【計算期間】	第19期(自 2020年12月1日至 2021年11月30日)
【ファンド名】	三井住友・日本株式インデックス年金ファンド
【発行者名】	三井住友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
【連絡場所】	東京都港区虎ノ門一丁目17番1号
【電話番号】	03-6205-1649
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主として日本の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ロ TOPIX（東証株価指数、配当込み）をベンチマークとして運用を行います。  
詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

## (イ) 当ファンドが該当する商品分類

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

## (ロ) 当ファンドが該当する属性区分

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

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
	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。

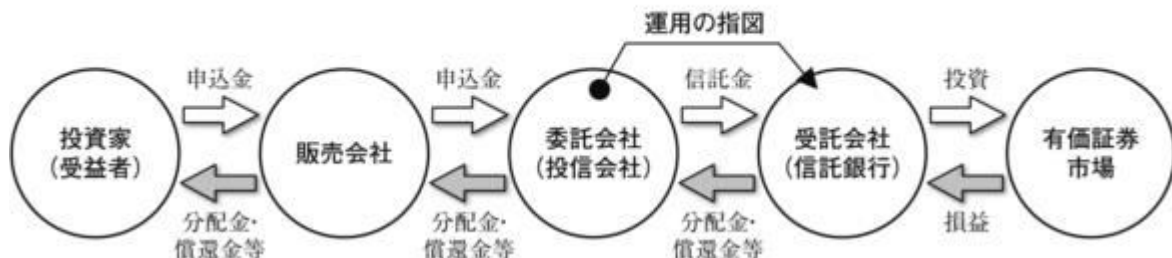
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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。

(ハ) 販売会社

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

### 運営の仕組み



### ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

20億円（2021年12月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

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

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

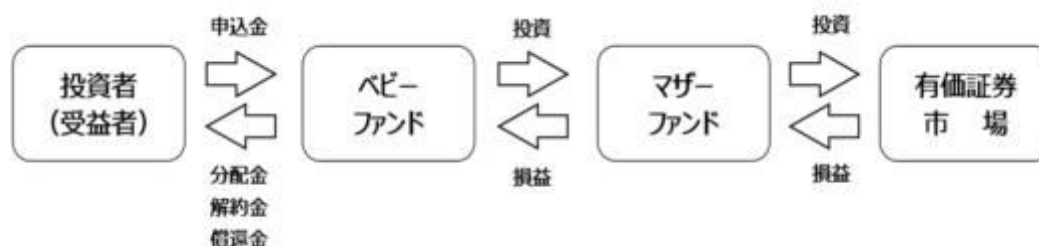
## (八) 大株主の状況

(2021年12月30日現在)

名称	住所	所有株式数(株)	比率(%)
株式会社三井住友フィナンシャルグループ	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	16,977,897	50.1
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	7,946,406	23.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	5,080,509	15.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	10.4
三井住友信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番1号	337,248	1.0

## 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<sup>\*</sup>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。

<sup>\*</sup>2022年4月4日以降は、T O P I X (東証株価指数)に採用されている銘柄の株式とする予定です。

(ロ) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

(ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金

動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

- (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。

\*2022年4月4日以降は、TOPIX(東証株価指数)に採用されている銘柄の株式とする予定です。



### TOPIX(東証株価指数)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、株式会社東京証券取引所が算出、公表を行っています。

※東京証券取引所の市場は2022年4月に新しい市場区分(プライム市場、スタンダード市場、グロース市場)への再編が予定されており、これに伴い、TOPIXの算出方法について変更が予定されています。

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。

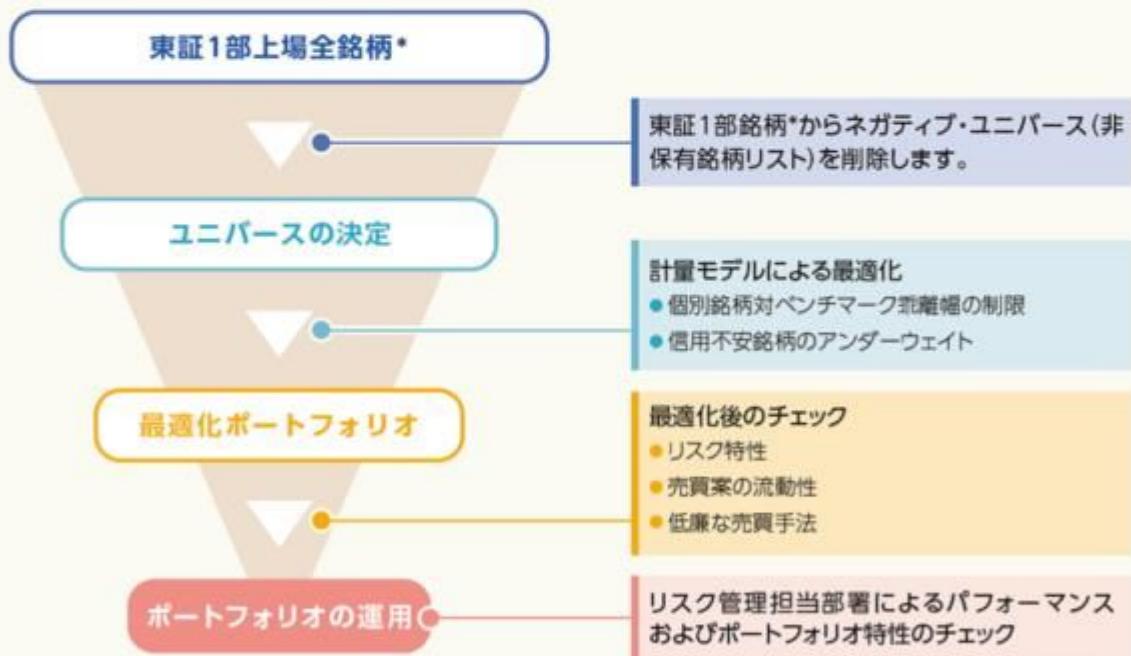
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## 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



\*2022年4月4日以降は、TOPIX(東証株価指数)採用銘柄とする予定です。



### 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。

## TOPIXの著作権など

- ・ TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、指数値の公表、利用など指数に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXの商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有します。
- ・ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値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ことができます。
- ・ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ・ 株式会社東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。
- ・ 当ファンドは、株式会社東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- ・ 株式会社東京証券取引所は、当ファンドの購入者または公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- ・ 株式会社東京証券取引所は、委託会社または当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ・ 以上の項目に限らず、株式会社東京証券取引所は当ファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## (2)【投資対象】

## イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

(イ) 次に掲げる特定資産(「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。)

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

(ロ) 次に掲げる特定資産以外の資産

1. 為替手形

## ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主としてマザーファンド受益証券および次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除き、かつ本邦通貨表示のものに限ります。)に投資することを指図します。

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

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



債」といいます。

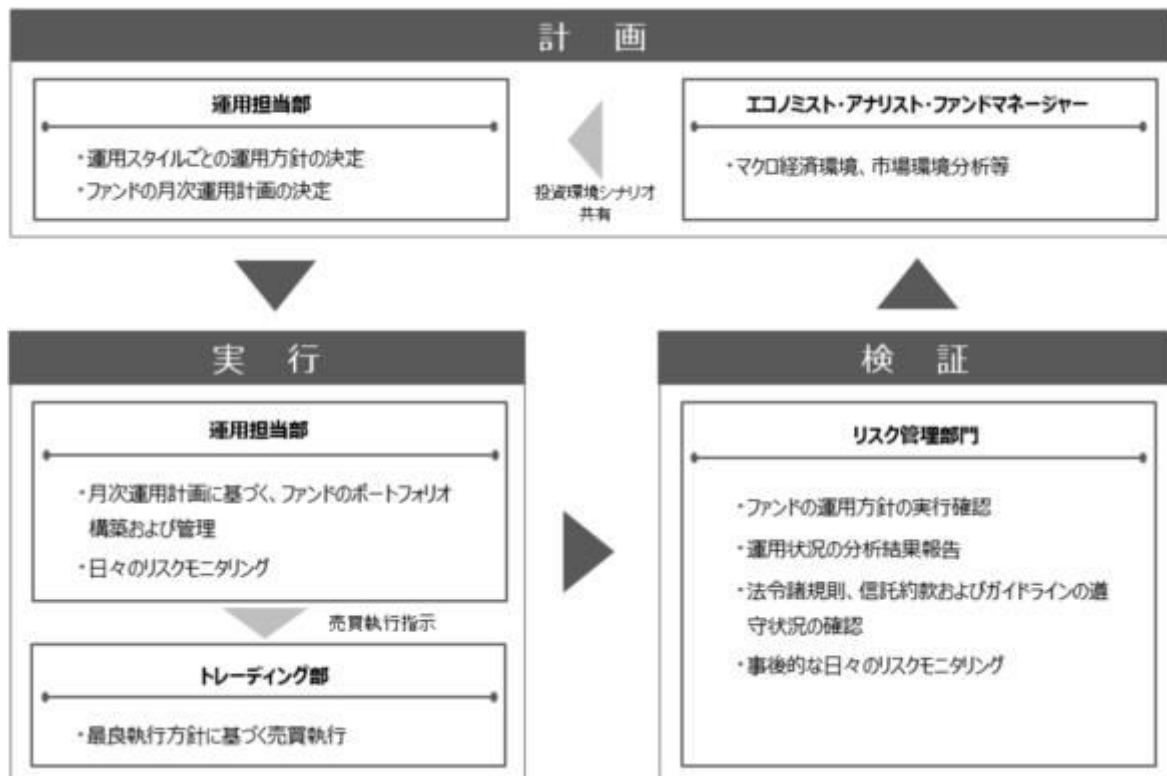
#### 八 投資対象とする金融商品

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

### （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。

#### ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

### （4）【分配方針】

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

- イ 分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ロ 分配金額は、委託会社が基準価額の水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額

の場合等や委託会社の判断によっては、分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

- 八 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。

ロ 株式への実質投資割合には制限を設けません。

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率(「組入比率」といいます。)と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます(以下同じ。)

- 八 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。

ロ 先物取引等の運用指図、目的、範囲

委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。

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。

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

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

(参考情報:国内株式インデックス・マザーファンド(B号)の投資方針等)

#### (1)投資方針等

##### イ 基本方針

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

##### ロ 投資態度

(イ)主として東京証券取引所第1部に上場している株式<sup>\*</sup>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。

\* 2022年4月4日以降は、T O P I X ( 東証株価指数 ) に採用されている銘柄の株式とする  
予定です。

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

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

## ( 2 ) 投資対象

### イ 投資対象とする資産の種類

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

### ロ 投資対象とする有価証券

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。

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

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

## 3【投資リスク】

### イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投  
資者の投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割  
り込むことがあります。

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

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

当ファンドの主要なリスクは以下の通りです。

#### ( イ ) 株式市場リスク

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

#### ( ロ ) 信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合  
に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりするこ

とがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

#### (八) 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。

#### (二) 対象インデックスの動きと連動しない要因

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が、以下の要因等により、対象インデックスの動きに連動しないことがあります。

- ・有価証券売買時のコスト、信託報酬やその他のファンド運営にかかる費用を負担すること
- ・追加設定・一部解約により組入有価証券の売買のタイミング差が生じること
- ・インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差が影響すること
- ・利用可能な指数先物と対象インデックスの動きに不一致が生じること

#### (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

ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要性が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。

これにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性、換金申込みの受け付けが中止となる可能性、既に受け付けた換金申込みが取り消しとなる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性等があります。

#### (ト) 収益分配金に関する留意事項

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



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

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

#### ロ 投資リスクの管理体制

委託会社では、運用部門から独立した組織を設置し、運用リスク管理を行っています。

リスク管理部は、信託約款等に定める各種投資制限やリスク指標のモニタリングを実施し、制限に対する抵触等があった場合には運用部門に対処要請等を行い、結果をリスク管理会議へ報告します。また、ファンドのパフォーマンスの分析・評価を行い、結果を運用評価会議等へ報告することで、運用方針等との整合性を維持するよう適切に管理しています。さらに、流動性リスク管理について規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングやストレステストを実施するとともに、緊



急時対応策等の策定や有効性の検証等を行います。なお、当該流動性リスクの適切な管理の実施等について、定期的にリスク管理会議へ報告します。

コンプライアンス部は、法令・諸規則等の遵守状況の確認等を行い、結果をコンプライアンス会議に報告します。

## （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。



### 〔 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。



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

※分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

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%	ファンドの運用およびそれに伴う調査、受託会社への指図、基準価額の算出、法定書面等の作成等の対価
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つたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

## (5) 【課税上の取扱い】

## イ 個別元本について

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

## ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

## ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



上記、の図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を



示唆するものではありません。

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・ 収益分配時

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

#### ・ 一部解約時および償還時

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

また、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等（上場株式、公募株式投資信託、上場投資信託（ETF）、上場不動産投資信託（REIT）、公募公社債投資信託および特定公社債をいいます。以下同じ。）の譲渡益ならびに上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）および利子所得の金額との損益通算が可能です。

### (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、2021年12月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	31,729,472,027	100.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	7,047,189	0.02
合計（純資産総額）		31,722,424,838	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

2021年12月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資 信託受 益証券	国内株式イン デックス・マ ザーファンド (B号)	9,516,652,778	3.2222	30,664,385,911	3.3341	31,729,472,027	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 種類別投資比率

2021年12月30日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.02
合計	100.02

## 【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
第18期 (2020年11月30日)	27,501,015,527	27,501,015,527	27,639	27,639
第19期 (2021年11月30日)	30,379,529,611	30,379,529,611	30,927	30,927
2020年12月末日	28,158,055,079	-	28,456	-
2021年 1月末日	28,049,052,973	-	28,518	-
2月末日	28,715,595,722	-	29,402	-
3月末日	30,475,499,460	-	31,071	-
4月末日	29,531,377,782	-	30,185	-
5月末日	29,919,381,820	-	30,592	-
6月末日	30,315,730,928	-	30,949	-
7月末日	29,662,738,955	-	30,271	-
8月末日	30,683,622,528	-	31,222	-
9月末日	31,864,794,862	-	32,576	-
10月末日	31,543,245,939	-	32,104	-
11月末日	30,379,529,611	-	30,927	-
12月末日	31,722,424,838	-	32,004	-

## 【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
第18期	2019年12月 3日～2020年11月30日	0
第19期	2020年12月 1日～2021年11月30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	4.6
第19期	11.9

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

## (4) 【設定及び解約の実績】

## 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第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	2,426,915,126	2,917,335,126
第19期	2,031,775,890	2,159,177,937

(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)

2021年12月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	204,383,864,360	98.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	3,963,292,801	1.90
合計(純資産総額)		208,347,157,161	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	3,924,240,000	1.88
合計	買建	-	3,924,240,000	1.88

## (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)

2021年12月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3,798,800	2,003.64	7,611,431,836	2,105.50	7,998,373,400	3.84
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	469,800	13,823.69	6,494,368,309	14,475.00	6,800,355,000	3.26
日本	株式	キーエンス	電気機器	68,000	70,378.11	4,785,711,297	72,280.00	4,915,040,000	2.36
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	552,900	6,900.72	3,815,407,059	6,972.00	3,854,818,800	1.85
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	47,600	59,853.01	2,849,003,312	66,280.00	3,154,928,000	1.51
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,639,100	602.24	2,793,841,840	624.90	2,898,973,590	1.39
日本	株式	日本電産	電気機器	194,400	13,010.08	2,529,159,528	13,520.00	2,628,288,000	1.26
日本	株式	信越化学工業	化学	126,100	19,014.01	2,397,666,480	19,920.00	2,511,912,000	1.21
日本	株式	HOYA	精密機器	146,400	18,010.78	2,636,778,312	17,110.00	2,504,904,000	1.20
日本	株式	ダイキン工業	機械	95,500	23,223.54	2,217,848,291	26,090.00	2,491,595,000	1.20
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	770,400	3,126.11	2,408,355,820	3,150.00	2,426,760,000	1.16
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	441,400	6,015.57	2,655,274,485	5,434.00	2,398,567,600	1.15
日本	株式	任天堂	その他製品	42,300	50,152.33	2,121,443,661	53,650.00	2,269,395,000	1.09
日本	株式	日立製作所	電気機器	360,700	6,683.50	2,410,739,209	6,230.00	2,247,161,000	1.08
日本	株式	三菱商事	卸売業	553,100	3,396.28	1,878,479,861	3,652.00	2,019,921,200	0.97

日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	511,900	3,708.30	1,898,277,375	3,943.00	2,018,421,700	0.97
日本	株式	村田製作所	電気機器	220,300	8,394.82	1,849,379,066	9,157.00	2,017,287,100	0.97
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	590,200	3,103.59	1,831,739,823	3,230.00	1,906,346,000	0.91
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	589,400	3,033.23	1,787,785,508	3,137.00	1,848,947,800	0.89
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	516,100	3,265.25	1,685,197,034	3,518.00	1,815,639,800	0.87
日本	株式	KDDI	情報・通信業	536,500	3,301.74	1,771,385,092	3,362.00	1,803,713,000	0.87
日本	株式	第一三共	医薬品	589,300	2,825.16	1,664,866,746	2,925.00	1,723,702,500	0.83
日本	株式	S M C	機械	22,000	72,748.77	1,600,472,871	77,590.00	1,706,980,000	0.82
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	84,700	17,870.78	1,513,654,759	19,395.00	1,642,756,500	0.79
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,115,100	1,560.97	1,740,635,478	1,454.50	1,621,912,950	0.78
日本	株式	ファナック	電気機器	65,800	22,285.33	1,466,374,728	24,380.00	1,604,204,000	0.77
日本	株式	デンソー	輸送用機器	165,000	8,350.77	1,377,876,890	9,529.00	1,572,285,000	0.75
日本	株式	三井物産	卸売業	573,300	2,558.25	1,466,645,929	2,723.50	1,561,382,550	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	243,500	5,719.87	1,392,788,718	6,392.00	1,556,452,000	0.75
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	288,700	4,564.05	1,317,640,331	5,056.00	1,459,667,200	0.70

□ 種類別・業種別投資比率

2021年12月30日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.23
	建設業	2.17
	食料品	3.20
	繊維製品	0.46
	パルプ・紙	0.20
	化学	6.62
	医薬品	4.69
	石油・石炭製品	0.39
	ゴム製品	0.67
	ガラス・土石製品	0.77
	鉄鋼	0.73
	非鉄金属	0.68
	金属製品	0.62
	機械	5.44
	電気機器	19.76
	輸送用機器	7.96
	精密機器	2.85
その他製品	2.18	
電気・ガス業	1.04	

陸運業	2.87
海運業	0.51
空運業	0.38
倉庫・運輸関連業	0.17
情報・通信業	7.83
卸売業	5.18
小売業	4.00
銀行業	4.65
証券、商品先物取引業	0.72
保険業	1.93
その他金融業	1.12
不動産業	1.80
サービス業	6.18
合計	98.10

## 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)

2021年12月30日現在

種類	地域	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	日本	大阪取引 所	TOPI X 先 物 0403 月 2022年 3月	買建	197	日本・円	3,901,456,700	3,924,240,000	1.88

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

## 参考情報

基準日:2021年12月30日

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

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## 分配の推移

決算期	分配金
2021年11月	0円
2020年11月	0円
2019年12月	0円
2018年11月	0円
2017年11月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

## 主要な資産の状況

### ■三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	100.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		△0.02
合計(純資産総額)		100.00

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	100.02

### ■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.90
合計(純資産総額)		100.00

※株価指数先物取引の買建て 1.88%

#### 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	3.84
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	3.26
日本	株式	キーエンス	電気機器	2.36
日本	株式	リフルートホールディングス	サービス業	1.85
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	1.51
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.39
日本	株式	日本電産	電気機器	1.26
日本	株式	信越化学工業	化学	1.21
日本	株式	HOYA	精密機器	1.20
日本	株式	ダイキン工業	機械	1.20

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

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

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



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



## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

## イ 申込方法

（イ）ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社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。

（ニ）定時定額で取得申込みをする「定時定額購入サービス」（販売会社によっては、名称が異なる場合があります。）を利用する場合は、販売会社との間で「定時定額購入サービス」に関する契約を締結します。詳細については、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

## 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	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

## 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。

ご購入の販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までには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。

解約単位の詳細および一部解約価額につきましては、お申込みの販売会社にお問い合わせください。

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	<a href="https://www.smd-am.co.jp">https://www.smd-am.co.jp</a>

お問い合わせは、午前9時～午後5時（土、日、祝・休日を除く）までとさせていただきます。

### （2）【保管】

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

証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

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無手数料で再投資され、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け、受益者への収益分配金、一部解約金および

償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

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無手数料で再投資され、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。

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。

## 二 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場合は、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19期(2020年12月1日から2021年11月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【三井住友・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18期 ( 2020年11月30日現在 )	第19期 ( 2021年11月30日現在 )
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	1,134,717
コール・ローン	81,465,064	33,466,548
親投資信託受益証券	27,536,069,933	30,422,407,212
流動資産合計	27,617,534,997	30,457,008,477
資産合計	27,617,534,997	30,457,008,477
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	81,457,682	34,582,833
未払受託者報酬	5,607,818	6,861,314
未払委託者報酬	29,440,985	36,021,957
未払利息	203	-
その他未払費用	12,782	12,762
流動負債合計	116,519,470	77,478,866
負債合計	116,519,470	77,478,866
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	9,950,238,793	9,822,836,746
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	17,550,776,734	20,556,692,865
( 分配準備積立金 )	5,660,091,141	7,182,225,327
元本等合計	27,501,015,527	30,379,529,611
純資産合計	27,501,015,527	30,379,529,611
負債純資産合計	27,617,534,997	30,457,008,477



## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第18期		第19期	
	自 至	2019年12月 3日 2020年11月30日	自 至	2020年12月 1日 2021年11月30日
営業収益				
受取利息		-		10
有価証券売買等損益		1,308,202,771		3,334,626,809
営業収益合計		1,308,202,771		3,334,626,819
営業費用				
支払利息		17,814		25,267
受託者報酬		11,112,262		13,245,167
委託者報酬		58,339,261		69,537,129
その他費用		38,446		28,770
営業費用合計		69,507,783		82,836,333
営業利益又は営業損失( )		1,238,694,988		3,251,790,486
経常利益又は経常損失( )		1,238,694,988		3,251,790,486
当期純利益又は当期純損失( )		1,238,694,988		3,251,790,486
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( )		436,219,177		609,453,912
期首剰余金又は期首欠損金( )		17,139,715,002		17,550,776,734
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,442,117,350		4,219,565,768
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,442,117,350		4,219,565,768
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,705,969,783		3,855,986,211
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,705,969,783		3,855,986,211
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( )		17,550,776,734		20,556,692,865

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針の注記)

項目	第19期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30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>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	第18期 (2020年11月30日現在)	第19期 (2021年11月30日現在)
	1. 当計算期間の末日における受益権の総数	9,950,238,793口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.7639円 (1万口当たりの純資産額27,639円)	1口当たり純資産額 3.0927円 (1万口当たりの純資産額30,927円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第18期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日	第19期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日
	分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(556,165,121円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(711,545,316円)、収益調整金(14,075,464,310円)、および分配準備積立金(4,392,380,704円)より、分配対象収益は19,735,555,451円(1万口当たり19,834.23円)であります、分配を行っておりません。</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	第19期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、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>

<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<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>
<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>	<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る場合、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19期 (2021年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<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ぬ。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<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>

	(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--	---

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

第18期(自 2019年12月3日 至 2020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	1,485,875,150円
合計	1,485,875,150円

第19期(自 2020年12月1日 至 2021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	3,080,385,187円
合計	3,080,385,187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19期 自 2020年12月1日 至 2021年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

## (その他の注記)

項 目	第18期	第19期
	(2020年11月30日現在)	(2021年11月30日現在)
期首元本額	10,440,658,793円	9,950,238,793円
期中追加設定元本額	2,426,915,126円	2,031,775,890円
期中一部解約元本額	2,917,335,126円	2,159,177,937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)	9,444,432,886	30,422,407,212	
	親投資信託受益証券 小計		30,422,407,212	
合 計			30,422,407,212	

## 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)

## ( 1 ) 貸借対照表

(単位:円)

	(2020年11月30日現在)	(2021年11月30日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	722,778	103,624,846
コール・ローン	2,067,474,050	3,056,237,624
株式	176,346,813,610	192,569,963,990
派生商品評価勘定	42,356,300	-
未収入金	1,473,618,306	-
未収配当金	1,157,091,319	1,330,297,687
前払金	-	133,950,000
差入委託証拠金	-	165,240,000
流動資産合計	181,088,076,363	197,359,314,147
資産合計		
	181,088,076,363	197,359,314,147
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	25,494,900	261,119,400
前受金	17,000,000	-
未払金	169,097,472	19,827,373
未払解約金	390,456,554	24,033,101
未払利息	5,163	-
その他未払費用	14,014	14,521
流動負債合計	602,068,103	304,994,395
負債合計		
	602,068,103	304,994,395
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	62,877,618,349	61,173,269,127
剰余金		

剰余金又は欠損金( )	117,608,389,911	135,881,050,625
元本等合計	180,486,008,260	197,054,319,752
純資産合計	180,486,008,260	197,054,319,752
負債純資産合計	181,088,076,363	197,359,314,147

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 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によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## (重要な会計上の見積りに関する注記)

会計上の見積りについて、翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目を識別していないため、注記を省略しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(2020年11月30日現在)	(2021年11月30日現在)
1. 担保資産	<p>デリバティブ取引に係る差入委託証拠金代用有価証券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 2,799,600,000円</p>	

2. 当計算期間の末日における受益権の総数	62,877,618,349口	61,173,269,127口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.8704円 (1万口当たりの純資産額28,704円)	1口当たり純資産額 3.2212円 (1万口当たりの純資産額32,212円)

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自 2020年12月1日 至 2021年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>



<p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>	<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>
<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>	<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る場合、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	(2021年11月30日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<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>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(2020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				
	TOPIX先物	3,599,468,600	-	3,616,330,000	16,861,400
	小計	3,599,468,600	-	3,616,330,000	16,861,400
合計		3,599,468,600	-	3,616,330,000	16,861,400

(2021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				
	TOPIX先物 0312 月	5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400
	小計	5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400
合計		5,076,959,400	-	4,815,840,000	261,119,400

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価の算定方法については以下のように評価しております。

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おります。

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おります。

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 2020年12月1日 至 2021年11月30日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はございません。

(その他の注記)

(2020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	63,743,430,458円
同期中における追加設定元本額	16,414,885,649円
同期中における一部解約元本額	17,280,697,758円

## 2020年11月30日現在の元本の内訳

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,593,112,435円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	924,099,772円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,437,512,099円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,182,148,801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)	171,397,205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)	5,673,022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)	23,413,868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)	66,326,513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)	127,855,299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)	95,770,146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)	191,642,664円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,182,656,821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	14,894,965,209円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	373,453,945円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	408,583,033円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	266,224,089円
イオン・バランス戦略ファンド	24,685,046円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	18,780,552円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	119,160,393円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	94,968,523円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	312,450,363円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	154,728,514円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	169,643,016円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	21,524,925円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	126,244,586円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	6,314,117円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	31,885,382円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	27,185,537円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	3,079,650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)	3,506,055,801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 >	19,074,070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 >	162,193,127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 >	2,502,207,801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 >	2,066,309,075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 >	7,670,534,834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 >	47,626,634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 >	197,754,086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 >	533,150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 >	845,219,384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 >	54,367,762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 >	341,176,214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 >	1,003,227,262円

SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	773,646,515円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	2,435,179,848円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	777,157円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	53,935,752円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	61,624,654円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	40,563,364円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	20,614,021円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	151,409,094円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	304,450,841円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	86,690,924円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	48,801,662円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,014,718円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	60,239,936円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	785,065,293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)	180,416,835円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	1,078,473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>	440,633,490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>	155,973,301円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,261,312,360円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	94,325,682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>	20,538,793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>	59,665,207円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	82,302,624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>	277,593,080円
合計	62,877,618,349円

## (2021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	62,877,618,349円
同期中における追加設定元本額	10,732,324,295円
同期中における一部解約元本額	12,436,673,517円

## 2021年11月30日現在の元本の内訳

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,444,432,886円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	893,111,379円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,314,610,252円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	3,302,572,824円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	123,293,850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)	4,679,600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)	20,378,358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)	62,968,056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)	145,617,764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)	123,379,159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)	223,865,395円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,383,108,545円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	18,142,394,620円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	277,082,196円

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	326,588,940円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	215,307,143円
イオン・バランス戦略ファンド	14,508,106円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2050	29,487,863円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	154,290,540円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	142,287,008円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	489,286,600円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	261,074,601円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	295,921,518円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	33,623,909円
三井住友D S・国内株式インデックス年金ファンド	440,586,720円
三井住友D S・年金バランス30(債券重点型)	14,302,327円
三井住友D S・年金バランス50(標準型)	71,078,321円
三井住友D S・年金バランス70(株式重点型)	69,299,615円
三井住友D S・DCターゲットイヤーファンド2060	4,018,342円
日興F W S・日本株インデックス	300,009,523円
三井住友D S・T O P I Xインデックス・ファンド	1,878,586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)	2,839,797,359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>	12,523,734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>	108,824,691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>	1,852,669,865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>	1,648,623,694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>	6,291,332,987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>	41,040,556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>	166,358,728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>	748,263,991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>	46,344,355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>	259,277,705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>	856,981,897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>	603,670,244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>	1,898,722,676円
S M A M・バランスV A株40T <適格機関投資家限定>	374,931円
S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定>	42,261,700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>	47,434,130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>	34,163,089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>	16,669,461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>	115,063,306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>	248,882,682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>	61,933,489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>	39,574,438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>	7,375,595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>	45,508,490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>	613,464,436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)	180,359,966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>	237,022,466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>	110,132,461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>	259,324,316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>	64,476,018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>	37,709,634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>	55,155,389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>	59,877,017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>	197,029,085円
合計	61,173,269,127円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,700	2,900.000	10,730,000	
日本水産	97,100	573.000	55,638,300	
マルハニチロ	15,000	2,277.000	34,155,000	
雪国まいたけ	8,100	1,217.000	9,857,700	
カネコ種苗	5,000	1,348.000	6,740,000	
サカタのタネ	11,600	3,125.000	36,250,000	
ホクト	8,000	1,842.000	14,736,000	
日鉄鉱業	2,300	6,160.000	14,168,000	
三井松島HLDGS	4,800	1,293.000	6,206,400	
INPEX	396,900	937.000	371,895,300	
石油資源開発	11,700	2,291.000	26,804,700	
K&Oエナジーグループ	5,500	1,502.000	8,261,000	
ヒノキヤグループ	2,900	2,118.000	6,142,200	
ショーボンドHD	14,100	4,885.000	68,878,500	
ミライト・ホールディングス	31,300	1,965.000	61,504,500	
タマホーム	6,100	2,290.000	13,969,000	
ベステラ	3,900	1,276.000	4,976,400	
ROBOT HOME	20,800	221.000	4,596,800	
ダイセキ環境ソリューション	2,700	1,658.000	4,476,600	
安藤・間	54,100	841.000	45,498,100	
東急建設	30,200	645.000	19,479,000	
コムシスホールディングス	31,600	2,476.000	78,241,600	
ビーアールホールディングス	17,000	353.000	6,001,000	
高松建設	6,700	1,869.000	12,522,300	
東建コーポレーション	2,900	8,950.000	25,955,000	
オリエンタル白石	36,700	227.000	8,330,900	
大成建設	66,000	3,310.000	218,460,000	
大林組	227,900	836.000	190,524,400	
清水建設	213,800	717.000	153,294,600	
飛島建設	8,700	977.000	8,499,900	
長谷工コーポレーション	67,200	1,354.000	90,988,800	
松井建設	11,600	703.000	8,154,800	

銭高組	1,700	3,765.000	6,400,500
鹿島建設	167,000	1,251.000	208,917,000
不動テトラ	5,800	1,612.000	9,349,600
大末建設	5,100	1,118.000	5,701,800
鉄建建設	6,500	1,717.000	11,160,500
西松建設	14,000	3,385.000	47,390,000
三井住友建設	53,200	414.000	22,024,800
大豊建設	3,500	3,620.000	12,670,000
奥村組	13,300	3,140.000	41,762,000
東鉄工業	9,900	2,273.000	22,502,700
浅沼組	2,900	5,260.000	15,254,000
戸田建設	95,700	668.000	63,927,600
熊谷組	11,200	2,628.000	29,433,600
北野建設	2,700	2,050.000	5,535,000
矢作建設	12,500	691.000	8,637,500
ピーエス三菱	9,300	593.000	5,514,900
日本ハウスHLDGS	20,700	347.000	7,182,900
大東建託	23,400	12,290.000	287,586,000
新日本建設	10,600	745.000	7,897,000
NIPPO	18,600	4,010.000	74,586,000
東亜道路	1,400	4,650.000	6,510,000
日本道路	2,200	7,800.000	17,160,000
東亜建設	5,900	2,379.000	14,036,100
日本国土開発	22,200	532.000	11,810,400
若築建設	4,800	1,900.000	9,120,000
東洋建設	25,700	524.000	13,466,800
五洋建設	91,200	651.000	59,371,200
世紀東急	12,800	824.000	10,547,200
福田組	2,800	4,110.000	11,508,000
住友林業	58,500	2,287.000	133,789,500
巴コーポレーション	14,600	432.000	6,307,200
大和ハウス	211,200	3,316.000	700,339,200
ライト工業	14,800	2,025.000	29,970,000
積水ハウス	247,900	2,210.000	547,859,000
北陸電気工事	5,200	1,051.000	5,465,200
ユアテック	14,100	601.000	8,474,100
日本リーテック	5,800	1,393.000	8,079,400
中電工	9,900	2,027.000	20,067,300
関電工	37,500	810.000	30,375,000
きんでん	50,000	1,643.000	82,150,000
東京エネシス	8,800	1,032.000	9,081,600
トーエネック	2,900	3,120.000	9,048,000
住友電設	5,800	1,926.000	11,170,800
日本電設工業	11,700	1,549.000	18,123,300
エクシオグループ	33,900	2,406.000	81,563,400
新日本空調	6,300	2,093.000	13,185,900
九電工	17,700	3,360.000	59,472,000
三機工業	13,600	1,373.000	18,672,800

日揮ホールディングス	70,900	957.000	67,851,300
中外炉工業	3,600	1,552.000	5,587,200
ヤマト	8,800	738.000	6,494,400
太平電業	5,300	2,706.000	14,341,800
高砂熱学	21,100	1,908.000	40,258,800
朝日工業社	2,200	2,809.000	6,179,800
明星工業	17,000	652.000	11,084,000
大 気 社	11,100	2,900.000	32,190,000
ダイダン	5,400	2,050.000	11,070,000
日比谷総合設備	7,500	1,864.000	13,980,000
フィル・カンパニー	1,700	2,192.000	3,726,400
テスホールディングス	4,700	2,422.000	11,383,400
インフロニアHD	97,400	939.000	91,458,600
東洋エンジニア	11,100	710.000	7,881,000
レイズネクスト	10,800	1,121.000	12,106,800
ニッポン	20,100	1,567.000	31,496,700
日清製粉G本社	82,200	1,636.000	134,479,200
昭和産業	6,400	2,617.000	16,748,800
鳥越製粉	8,700	710.000	6,177,000
中部飼料	8,600	944.000	8,118,400
フィード・ワン	10,300	714.000	7,354,200
日本甜菜糖	5,300	1,595.000	8,453,500
DM三井製糖ホールディ	6,400	1,862.000	11,916,800
日新製糖	4,300	1,629.000	7,004,700
森永製菓	17,300	3,530.000	61,069,000
中 村 屋	2,500	3,605.000	9,012,500
江崎グリコ	20,000	3,505.000	70,100,000
名糖産業	5,000	1,650.000	8,250,000
井村屋グループ	4,500	2,162.000	9,729,000
不 二 家	4,400	2,232.000	9,820,800
山崎製パン	54,700	1,475.000	80,682,500
モロゾフ	1,700	5,290.000	8,993,000
亀田製菓	4,100	4,325.000	17,732,500
寿スピリッツ	7,000	6,160.000	43,120,000
カルビー	33,400	2,548.000	85,103,200
森永乳業	13,600	5,440.000	73,984,000
六甲バター	6,500	1,528.000	9,932,000
ヤクルト	54,100	5,670.000	306,747,000
明治ホールディングス	48,100	6,660.000	320,346,000
雪印メグミルク	17,400	1,920.000	33,408,000
プリマハム	8,400	2,371.000	19,916,400
日本ハム	27,700	3,870.000	107,199,000
丸大食品	7,800	1,433.000	11,177,400
S F o o d s	6,300	3,285.000	20,695,500
柿安本店	2,900	2,590.000	7,511,000
伊藤ハム米久HLDGS	41,400	642.000	26,578,800
サッポロホールディングス	25,000	2,180.000	54,500,000
アサヒグループホールディン	171,800	4,194.000	720,529,200



キリンHD	268,300	1,817.000	487,501,100
宝ホールディングス	50,200	1,220.000	61,244,000
オエノンホールディングス	24,500	356.000	8,722,000
養命酒	3,700	1,770.000	6,549,000
コカ・コーラボトラーズJHD	50,900	1,265.000	64,388,500
サントリー食品インター	48,800	4,005.000	195,444,000
ダイドーグループHD	3,700	4,910.000	18,167,000
伊藤園	22,200	6,670.000	148,074,000
キーコーヒー	6,900	1,941.000	13,392,900
日清オイリオグループ	8,400	2,778.000	23,335,200
不二製油グループ	15,800	2,236.000	35,328,800
かどや製油	1,400	4,040.000	5,656,000
J・オイルミルズ	7,400	1,651.000	12,217,400
キッコーマン	52,600	8,660.000	455,516,000
味の素	161,300	3,407.000	549,549,100
ブルドックソース	3,900	2,049.000	7,991,100
キューピー	38,300	2,309.000	88,434,700
ハウス食品G本社	27,200	2,789.000	75,860,800
カゴメ	27,600	2,765.000	76,314,000
焼津水産化工	7,700	931.000	7,168,700
アリアケジャパン	6,700	6,400.000	42,880,000
ニチレイ	34,900	2,601.000	90,774,900
東洋水産	35,000	4,600.000	161,000,000
イトアンドHLDGS	3,600	2,079.000	7,484,400
日清食品HD	28,600	8,340.000	238,524,000
永谷園ホールディングス	4,100	1,933.000	7,925,300
一正蒲鉾	6,600	853.000	5,629,800
フジッコ	7,500	1,808.000	13,560,000
ロックフィールド	7,900	1,438.000	11,360,200
日本たばこ産業	391,800	2,273.500	890,757,300
ケンコーマヨネーズ	5,200	1,271.000	6,609,200
わらべや日洋HD	5,300	1,842.000	9,762,600
なとり	5,200	1,901.000	9,885,200
ピクルスコーポレーション	4,100	1,765.000	7,236,500
ファーマフーズ	7,000	2,272.000	15,904,000
ユーグレナ	38,500	795.000	30,607,500
紀文食品	5,000	979.000	4,895,000
ミヨシ油脂	5,100	1,267.000	6,461,700
理研ビタミン	8,100	1,603.000	12,984,300
グンゼ	5,100	3,945.000	20,119,500
東洋紡	29,200	1,195.000	34,894,000
ユニチカ	23,100	289.000	6,675,900
富士紡ホールディングス	3,500	3,765.000	13,177,500
倉敷紡績	6,700	1,822.000	12,207,400
シキボウ	8,200	894.000	7,330,800
日本毛織	23,300	841.000	19,595,300
帝国繊維	9,100	1,973.000	17,954,300
帝人	68,000	1,301.000	88,468,000

東レ	519,200	660.800	343,087,360
住江織物	3,300	1,534.000	5,062,200
アツギ	10,200	666.000	6,793,200
ダイニツク	7,400	685.000	5,069,000
セーレン	15,500	2,273.000	35,231,500
小松マテーレ	13,000	1,177.000	15,301,000
ワコールホールディングス	18,400	2,013.000	37,039,200
ホギメディカル	10,200	3,000.000	30,600,000
T S Iホールディングス	27,300	345.000	9,418,500
マツオカコーポレーション	3,500	1,217.000	4,259,500
ワールド	11,000	1,189.000	13,079,000
オンワードホールディングス	47,400	288.000	13,651,200
ゴールドウイン	13,000	6,450.000	83,850,000
デサント	14,200	4,610.000	65,462,000
特種東海製紙	4,700	4,025.000	18,917,500
王子ホールディングス	297,100	525.000	155,977,500
日本製紙	35,200	1,066.000	37,523,200
北越コーポレーション	47,800	780.000	37,284,000
大王製紙	35,200	1,799.000	63,324,800
レンゴー	68,600	767.000	52,616,200
トーモク	5,600	1,761.000	9,861,600
ザ・パック	5,900	2,680.000	15,812,000
北の達人コーポ	26,600	356.000	9,469,600
クラレ	103,400	944.000	97,609,600
旭化成	473,000	1,071.500	506,819,500
昭和電工	61,900	2,502.000	154,873,800
住友化学	520,700	524.000	272,846,800
住友精化	3,600	3,020.000	10,872,000
日産化学	38,800	6,540.000	253,752,000
ラサ工業	2,800	1,658.000	4,642,400
クレハ	5,600	7,900.000	44,240,000
多木化学	2,900	5,450.000	15,805,000
テイカ	6,200	1,163.000	7,210,600
石原産業	12,200	1,166.000	14,225,200
日本曹達	9,000	3,215.000	28,935,000
東ソー	102,600	1,631.000	167,340,600
トクヤマ	23,000	1,784.000	41,032,000
セントラル硝子	12,000	1,944.000	23,328,000
東亜合成	40,900	1,176.000	48,098,400
大阪ソーダ	6,400	2,555.000	16,352,000
関東電化	16,200	1,008.000	16,329,600
デンカ	25,900	3,345.000	86,635,500
信越化学	122,600	19,000.000	2,329,400,000
堺化学	5,200	2,096.000	10,899,200
第一稀元素化学工	8,400	1,278.000	10,735,200
エア・ウォーター	67,300	1,677.000	112,862,100
日本酸素HLDGS	68,500	2,403.000	164,605,500
日本化学工業	2,600	2,520.000	6,552,000

日本パ - カライジング	36,400	1,060.000	38,584,000
高圧ガス	13,100	736.000	9,641,600
四国化成	9,400	1,366.000	12,840,400
ステラ ケミファ	4,000	2,500.000	10,000,000
保土谷化学	2,400	4,625.000	11,100,000
日本触媒	12,100	5,070.000	61,347,000
大日精化	5,700	2,200.000	12,540,000
カネカ	18,400	3,700.000	68,080,000
三菱瓦斯化学	66,200	1,889.000	125,051,800
三井化学	64,500	3,045.000	196,402,500
J S R	66,500	4,240.000	281,960,000
東京応化工業	12,300	7,120.000	87,576,000
大阪有機化学	6,000	3,650.000	21,900,000
三菱ケミカルH L D G S	476,700	892.200	425,311,740
K Hネオケム	11,800	3,080.000	36,344,000
ダイセル	103,300	783.000	80,883,900
住友ベ - クライト	11,300	5,310.000	60,003,000
積水化学	148,600	1,845.000	274,167,000
日本ゼオン	64,700	1,203.000	77,834,100
アイカ工業	20,000	3,315.000	66,300,000
宇部興産	33,200	1,900.000	63,080,000
積水樹脂	10,800	2,019.000	21,805,200
タキロンシーアイ	16,500	522.000	8,613,000
旭有機材	4,900	1,490.000	7,301,000
ニチバン	5,700	1,747.000	9,957,900
リケンテクノス	19,300	481.000	9,283,300
大倉工業	4,200	2,052.000	8,618,400
群栄化学	2,500	3,275.000	8,187,500
ミライアル	2,900	1,627.000	4,718,300
ダイキョーニシカワ	16,300	537.000	8,753,100
森六ホールディングス	5,000	1,710.000	8,550,000
恵和	1,900	6,130.000	11,647,000
日本化薬	56,800	1,114.000	63,275,200
カーリットホールディングス	8,800	653.000	5,746,400
日本精化	6,000	2,000.000	12,000,000
扶桑化学工業	6,400	4,720.000	30,208,000
トリケミカル	7,300	3,500.000	25,550,000
A D E K A	32,800	2,411.000	79,080,800
日油	24,300	5,600.000	136,080,000
新日本理化	20,100	244.000	4,904,400
ハリマ化成グループ	7,300	791.000	5,774,300
花 王	161,300	5,787.000	933,443,100
第一工業製薬	3,100	3,095.000	9,594,500
石原ケミカル	4,500	1,265.000	5,692,500
ニイタカ	2,400	2,250.000	5,400,000
三洋化成	4,100	5,090.000	20,869,000
大日本塗料	11,000	791.000	8,701,000
日本ペイントH O L D	268,500	1,193.000	320,320,500

関西ペイント	74,100	2,550.000	188,955,000
中国塗料	17,700	862.000	15,257,400
日本特殊塗料	7,000	793.000	5,551,000
藤倉化成	11,700	490.000	5,733,000
太陽ホールディングス	10,400	3,225.000	33,540,000
D I C	30,100	2,845.000	85,634,500
サカタインクス	14,400	972.000	13,996,800
東洋インキS Cホールディン	13,800	1,875.000	25,875,000
T & K T O K A	8,400	746.000	6,266,400
富士フイルムH L D G S	128,100	8,931.000	1,144,061,100
資 生 堂	135,800	6,503.000	883,107,400
ライオン	88,000	1,611.000	141,768,000
高砂香料	5,000	2,750.000	13,750,000
マンダム	15,700	1,424.000	22,356,800
ミルボン	9,100	5,760.000	52,416,000
ファンケル	29,500	3,425.000	101,037,500
コーセー	13,700	13,670.000	187,279,000
コタ	6,000	1,505.000	9,030,000
ポーラ・オルビスHD	31,400	2,022.000	63,490,800
ノエビアホールディングス	6,100	5,250.000	32,025,000
新日本製薬	3,600	1,243.000	4,474,800
エステー	5,600	1,537.000	8,607,200
コ ニ シ	11,900	1,598.000	19,016,200
長谷川香料	12,400	2,812.000	34,868,800
小林製薬	20,400	8,920.000	181,968,000
荒川化学工業	7,200	1,129.000	8,128,800
メック	5,500	4,120.000	22,660,000
タカラバイオ	19,000	2,639.000	50,141,000
J C U	8,000	4,800.000	38,400,000
デクセリアルズ	18,900	3,345.000	63,220,500
アース製薬	6,000	6,140.000	36,840,000
北興化学	7,800	846.000	6,598,800
大成ラミック	3,300	2,740.000	9,042,000
クミアイ化学	27,500	798.000	21,945,000
日本農薬	16,100	465.000	7,486,500
アキレス	6,200	1,209.000	7,495,800
有沢製作所	11,700	925.000	10,822,500
日東電工	44,000	7,900.000	347,600,000
レック	11,000	819.000	9,009,000
藤森工業	6,400	3,580.000	22,912,000
前澤化成工業	6,800	1,251.000	8,506,800
未来工業	3,800	1,616.000	6,140,800
ジェイ エス ピー	5,200	1,515.000	7,878,000
エフピコ	13,600	3,745.000	50,932,000
天馬	6,000	2,402.000	14,412,000
信越ポリマー	13,400	951.000	12,743,400
東 リ	27,300	219.000	5,978,700
ニ フ コ	24,400	3,120.000	76,128,000

バルカー	6,000	2,442.000	14,652,000
ユニ・チャーム	140,500	4,888.000	686,764,000
協和キリン	85,300	3,170.000	270,401,000
武田薬品	572,500	3,031.000	1,735,247,500
アステラス製薬	631,500	1,779.500	1,123,754,250
大日本住友製薬	45,300	1,382.000	62,604,600
塩野義製薬	91,500	7,923.000	724,954,500
日本新薬	19,100	8,400.000	160,440,000
中外製薬	227,800	3,680.000	838,304,000
科研製薬	11,500	4,045.000	46,517,500
エーザイ	87,100	6,873.000	598,638,300
ロート製薬	37,500	3,235.000	121,312,500
小野薬品	167,000	2,505.500	418,418,500
久光製薬	19,200	3,990.000	76,608,000
持田製薬	9,400	3,180.000	29,892,000
参天製薬	135,800	1,504.000	204,243,200
扶桑薬品	3,400	2,369.000	8,054,600
日本ケミファ	2,500	2,041.000	5,102,500
ツムラ	22,600	3,235.000	73,111,000
日医工	23,300	672.000	15,657,600
キッセイ薬品工業	13,200	2,284.000	30,148,800
生化学工業	13,000	938.000	12,194,000
栄研化学	12,700	1,893.000	24,041,100
鳥居薬品	4,100	2,778.000	11,389,800
JCRファーマ	20,700	2,499.000	51,729,300
東和薬品	10,200	2,626.000	26,785,200
富士製薬工業	6,300	1,080.000	6,804,000
ゼリア新薬工業	13,100	1,919.000	25,138,900
第一三共	572,500	2,824.500	1,617,026,250
キョーリン製薬HD	14,500	1,688.000	24,476,000
大幸薬品	12,900	808.000	10,423,200
ダイト	4,800	2,841.000	13,636,800
大塚ホールディングス	151,300	4,146.000	627,289,800
大正製薬HD	17,200	5,580.000	95,976,000
ペプチドリーム	38,400	2,862.000	109,900,800
あすか製薬HD	9,200	962.000	8,850,400
サワイグループHD	16,000	4,200.000	67,200,000
日本コークス工業	69,200	122.000	8,442,400
ニチレキ	10,400	1,307.000	13,592,800
ユシロ化学	7,000	1,038.000	7,266,000
MORESCO	5,400	1,077.000	5,815,800
出光興産	80,600	2,931.000	236,238,600
ENEOSホールディングス	1,096,100	423.400	464,088,740
コスモエネルギーHLDGS	21,200	2,225.000	47,170,000
横浜ゴム	41,800	1,766.000	73,818,800
TOYO TIRE	38,600	1,726.000	66,623,600
ブリヂストン	209,800	4,605.000	966,129,000
住友ゴム	65,400	1,139.000	74,490,600

藤倉コンポジット	7,400	788.000	5,831,200
オカモト	4,400	3,770.000	16,588,000
ニッタ	7,600	2,602.000	19,775,200
住友理工	15,800	574.000	9,069,200
三ツ星ベルト	8,900	1,932.000	17,194,800
バンドー化学	13,000	850.000	11,050,000
日東紡績	11,000	2,666.000	29,326,000
A G C	66,800	5,550.000	370,740,000
日本板硝子	19,600	502.000	9,839,200
日本電気硝子	29,500	2,939.000	86,700,500
オハラ	3,800	1,363.000	5,179,400
住友大阪セメント	13,800	3,450.000	47,610,000
太平洋セメント	41,600	2,199.000	91,478,400
日本ヒュ - ム	12,100	666.000	8,058,600
日本コンクリ - ト	22,900	252.000	5,770,800
三谷セキサン	3,600	7,080.000	25,488,000
アジアパイルHD	16,500	412.000	6,798,000
東海カーボン	61,200	1,177.000	72,032,400
日本カーボン	3,800	4,145.000	15,751,000
東洋炭素	4,800	3,110.000	14,928,000
ノリタケ	4,100	4,630.000	18,983,000
T O T O	52,100	5,030.000	262,063,000
日本碍子	78,700	1,797.000	141,423,900
日本特殊陶業	55,400	1,888.000	104,595,200
M A R U W A	2,600	13,400.000	34,840,000
品川リフラクトリーズ	2,000	3,475.000	6,950,000
黒崎播磨	1,600	3,900.000	6,240,000
ヨータイ	5,400	1,211.000	6,539,400
東京窯業	15,300	294.000	4,498,200
フジインコーポレーテッド	6,000	7,350.000	44,100,000
ニチアス	17,700	2,566.000	45,418,200
ニチハ	10,200	2,791.000	28,468,200
日本製鉄	322,200	1,699.500	547,578,900
神戸製鋼所	133,700	549.000	73,401,300
中山製鋼所	14,900	413.000	6,153,700
合同製鐵	5,200	1,314.000	6,832,800
J F Eホールディングス	194,000	1,316.000	255,304,000
東京製鐵	24,600	1,203.000	29,593,800
共英製鋼	9,100	1,251.000	11,384,100
大和工業	14,000	3,485.000	48,790,000
東京鐵鋼	4,700	1,241.000	5,832,700
淀川製鋼所	9,600	2,280.000	21,888,000
丸一鋼管	25,600	2,427.000	62,131,200
モリ工業	2,600	2,574.000	6,692,400
大同特殊鋼	11,900	3,930.000	46,767,000
日本冶金工	5,500	2,043.000	11,236,500
山陽特殊製鋼	7,600	1,818.000	13,816,800
愛知製鋼	4,700	2,427.000	11,406,900

日立金属	77,300	2,102.000	162,484,600
大太平洋金属	4,900	2,030.000	9,947,000
新日本電工	47,200	292.000	13,782,400
栗本鉄工所	4,700	1,473.000	6,923,100
三菱製鋼	5,700	970.000	5,529,000
日本精線	1,500	4,375.000	6,562,500
エンビプロHD	3,400	1,897.000	6,449,800
大紀アルミニウム	10,600	1,462.000	15,497,200
日本軽金属HD	18,400	1,669.000	30,709,600
三井金属	19,300	2,930.000	56,549,000
東邦亜鉛	4,600	2,122.000	9,761,200
三菱マテリアル	47,400	1,954.000	92,619,600
住友鉱山	92,100	4,233.000	389,859,300
DOWAホールディングス	19,500	4,220.000	82,290,000
古河機金	11,800	1,198.000	14,136,400
大阪チタニウム	11,000	780.000	8,580,000
東邦チタニウム	13,500	948.000	12,798,000
UACJ	10,800	2,295.000	24,786,000
CKサンエツ	2,000	3,355.000	6,710,000
古河電工	22,600	2,255.000	50,963,000
住友電工	269,800	1,489.500	401,867,100
フジクラ	80,400	573.000	46,069,200
昭和電線HLDGS	6,400	1,878.000	12,019,200
タツタ電線	14,900	461.000	6,868,900
平河ヒューテック	5,400	1,102.000	5,950,800
リョービ	10,200	1,007.000	10,271,400
アサヒHD	28,700	1,914.000	54,931,800
宮地エンジニアリングG	3,200	2,906.000	9,299,200
トーカロ	18,400	1,484.000	27,305,600
アルファCO	4,900	1,070.000	5,243,000
SUMCO	110,900	2,488.000	275,919,200
川田テクノロジーズ	2,100	3,695.000	7,759,500
RS TECHNOLOGIES	2,400	6,440.000	15,456,000
東洋製罐グループHD	46,300	1,386.000	64,171,800
ホッカンホールディングス	5,400	1,410.000	7,614,000
横河ブリッジHLDGS	12,400	2,121.000	26,300,400
駒井ハルテック	3,100	1,720.000	5,332,000
三和ホールディングス	68,400	1,213.000	82,969,200
文化シャツタ-	23,000	1,009.000	23,207,000
三協立山	12,000	684.000	8,208,000
アルインコ	8,000	934.000	7,472,000
LIXIL	113,400	2,789.000	316,272,600
ノーリツ	13,900	1,629.000	22,643,100
長府製作所	7,300	2,001.000	14,607,300
リンナイ	13,600	10,720.000	145,792,000
日東精工	13,000	593.000	7,709,000
岡部	18,000	674.000	12,132,000
ジーテクト	9,200	1,333.000	12,263,600

東 プ レ	13,700	1,091.000	14,946,700
高周波熱錬	16,300	553.000	9,013,900
東京製綱	7,000	760.000	5,320,000
パイオラックス	11,000	1,610.000	17,710,000
エイチワン	9,900	621.000	6,147,900
日本発条	66,800	847.000	56,579,600
立川ブラインド	5,000	1,090.000	5,450,000
三益半導体	5,600	2,341.000	13,109,600
日本製鋼所	22,200	3,425.000	76,035,000
三浦工業	31,300	3,985.000	124,730,500
タ ク マ	24,100	1,370.000	33,017,000
ツ ガ ミ	17,400	1,411.000	24,551,400
オークマ	8,500	4,745.000	40,332,500
芝浦機械	8,300	3,370.000	27,971,000
アマダ	113,400	1,063.000	120,544,200
アイダエンジニア	19,000	922.000	17,518,000
F U J I	33,000	2,489.000	82,137,000
牧野フライス	7,800	3,455.000	26,949,000
オーエスジー	34,000	1,646.000	55,964,000
旭ダイヤモンド	19,400	634.000	12,299,600
D M G 森精機	42,900	1,774.000	76,104,600
ソディック	16,800	767.000	12,885,600
ディスコ	10,600	32,600.000	345,560,000
日東工器	4,800	1,740.000	8,352,000
日進工具	6,300	1,429.000	9,002,700
島精機製作所	10,800	1,908.000	20,606,400
オプトラン	9,300	2,243.000	20,859,900
N C ホールディングス	3,000	1,388.000	4,164,000
フリュー	7,200	1,272.000	9,158,400
ヤマシンフィルタ	15,400	523.000	8,054,200
日阪製作所	11,300	788.000	8,904,400
やまびこ	13,900	1,248.000	17,347,200
野村マイクロ・サイエンス	2,000	4,845.000	9,690,000
平田機工	3,500	5,970.000	20,895,000
マルマエ	3,300	2,993.000	9,876,900
タツモ	4,200	1,669.000	7,009,800
ナブテスコ	41,100	3,285.000	135,013,500
三井海洋開発	8,200	1,398.000	11,463,600
レオン自動機	8,600	1,309.000	11,257,400
S M C	21,300	72,650.000	1,547,445,000
ホソカワミクロン	5,100	2,842.000	14,494,200
ユニオンツール	2,800	3,745.000	10,486,000
オイレス工業	10,000	1,643.000	16,430,000
日精エーエスビー	2,700	2,844.000	7,678,800
サト - ホールディングス	9,700	2,126.000	20,622,200
技研製作所	6,400	4,130.000	26,432,000
日本エアーテック	4,700	1,210.000	5,687,000
日精樹脂工業	6,500	980.000	6,370,000



小松製作所	330,500	2,592.000	856,656,000
住友重機械	41,600	2,521.000	104,873,600
日立建機	29,200	3,300.000	96,360,000
日工	13,600	610.000	8,296,000
巴工業	3,500	2,288.000	8,008,000
井関農機	7,700	1,409.000	10,849,300
TOWA	6,500	3,200.000	20,800,000
北川鉄工所	4,800	1,393.000	6,686,400
ローツェ	3,600	11,950.000	43,020,000
クボタ	355,800	2,369.000	842,890,200
荏原実業	3,600	2,510.000	9,036,000
三菱化工機	3,000	2,265.000	6,795,000
月島機械	13,800	1,068.000	14,738,400
帝国電機製作所	6,100	1,391.000	8,485,100
新東工業	18,500	677.000	12,524,500
渋谷工業	6,400	2,858.000	18,291,200
アイチ コーポレーション	11,800	779.000	9,192,200
小森コーポレーション	20,400	630.000	12,852,000
鶴見製作所	6,300	1,530.000	9,639,000
荏原製作所	30,300	6,100.000	184,830,000
西島製作所	10,000	863.000	8,630,000
北越工業	9,100	946.000	8,608,600
ダイキン工業	92,900	23,150.000	2,150,635,000
オルガノ	2,000	6,820.000	13,640,000
ト・ヨ・カネツ	3,400	2,494.000	8,479,600
栗田工業	39,400	5,300.000	208,820,000
椿本チエイン	9,500	2,875.000	27,312,500
大同工業	5,300	852.000	4,515,600
木村化工機	7,500	986.000	7,395,000
アネスト岩田	12,800	854.000	10,931,200
ダイフク	40,000	9,090.000	363,600,000
サムコ	2,300	2,911.000	6,695,300
タダノ	39,000	1,008.000	39,312,000
フジテック	27,300	2,382.000	65,028,600
CKD	21,400	2,223.000	47,572,200
キトー	7,200	1,754.000	12,628,800
平和	20,400	1,848.000	37,699,200
理想科学工業	6,400	2,022.000	12,940,800
SANKYO	16,100	2,894.000	46,593,400
日本金銭機械	9,100	688.000	6,260,800
マースグループHLDGS	6,200	1,590.000	9,858,000
フクシマガリレイ	5,100	4,180.000	21,318,000
ダイコク電機	5,000	1,190.000	5,950,000
竹内製作所	11,000	2,718.000	29,898,000
アマノ	19,300	2,491.000	48,076,300
JUKI	11,800	919.000	10,844,200
ジャノメ	8,100	622.000	5,038,200
マックス	9,900	1,795.000	17,770,500

グローリー	19,200	2,075.000	39,840,000
新晃工業	7,000	1,831.000	12,817,000
大和冷機工業	10,500	1,206.000	12,663,000
セガサミーホールディングス	72,500	1,845.000	133,762,500
日本ピストンリング	4,400	1,219.000	5,363,600
リケン	3,700	2,437.000	9,016,900
T P R	10,000	1,368.000	13,680,000
ツバキ・ナカシマ	16,500	1,370.000	22,605,000
ホシザキ	21,300	8,620.000	183,606,000
大豊工業	8,200	728.000	5,969,600
日本精工	136,100	771.000	104,933,100
N T N	157,900	210.000	33,159,000
ジェイテクト	69,600	992.000	69,043,200
不二越	6,100	3,860.000	23,546,000
日本トムソン	22,100	691.000	15,271,100
T H K	42,500	2,711.000	115,217,500
ユーシン精機	8,700	728.000	6,333,600
前澤給装工業	7,300	1,001.000	7,307,300
イーグル工業	10,000	1,025.000	10,250,000
日本ビラ - 工業	7,400	3,200.000	23,680,000
キッツ	25,300	701.000	17,735,300
マキタ	88,900	4,984.000	443,077,600
日立造船	61,600	841.000	51,805,600
三菱重工業	114,600	2,561.000	293,490,600
I H I	45,600	2,141.000	97,629,600
スター精密	11,600	1,446.000	16,773,600
日清紡ホールディングス	44,900	819.000	36,773,100
イビデン	38,200	7,070.000	270,074,000
コニカミノルタ	160,300	469.000	75,180,700
ブラザー工業	88,800	1,954.000	173,515,200
ミネベアミツミ	125,200	3,000.000	375,600,000
日立	350,500	6,688.000	2,344,144,000
東芝	127,300	4,527.000	576,287,100
三菱電機	729,000	1,424.500	1,038,460,500
富士電機	43,900	5,940.000	260,766,000
安川電機	78,300	5,090.000	398,547,000
シンフォニアテクノロジー	9,500	1,261.000	11,979,500
明電舎	12,600	2,588.000	32,608,800
オリジン	4,300	1,262.000	5,426,600
山洋電気	3,300	5,670.000	18,711,000
デンヨー	7,000	1,657.000	11,599,000
P H Cホールディングス	8,000	2,298.000	18,384,000
東芝テック	7,900	4,355.000	34,404,500
芝浦メカトロニクス	1,400	8,250.000	11,550,000
マブチモーター	17,100	3,730.000	63,783,000
日本電産	188,900	13,000.000	2,455,700,000
トレックス・セミコンダクター	4,200	3,785.000	15,897,000
東光高岳	5,200	1,304.000	6,780,800

ダイヘン	8,000	4,300.000	34,400,000
ヤーマン	12,400	1,008.000	12,499,200
JVCケンウッド	65,900	165.000	10,873,500
ミマキエンジニアリング	8,500	882.000	7,497,000
I - P E X	4,100	1,940.000	7,954,000
日新電機	17,200	1,417.000	24,372,400
大崎電気	18,000	441.000	7,938,000
オムロン	60,700	10,965.000	665,575,500
日東工業	9,800	1,487.000	14,572,600
I D E C	9,400	2,688.000	25,267,200
ジーエス・ユアサ コーポ	24,400	2,306.000	56,266,400
メルコホールディングス	2,200	3,900.000	8,580,000
日本電気	92,500	5,120.000	473,600,000
富士通	65,600	18,795.000	1,232,952,000
沖電気	31,100	838.000	26,061,800
電気興業	4,400	2,518.000	11,079,200
サンケン電気	6,900	5,780.000	39,882,000
アイホン	4,700	2,087.000	9,808,900
ルネサスエレクトロニクス	394,700	1,442.000	569,157,400
セイコーエプソン	90,500	1,830.000	165,615,000
ワコム	56,500	874.000	49,381,000
アルバック	13,500	6,500.000	87,750,000
E I Z O	5,700	3,940.000	22,458,000
日本信号	19,100	861.000	16,445,100
京三製作所	18,700	431.000	8,059,700
能美防災	9,900	1,999.000	19,790,100
ホーチキ	6,500	1,246.000	8,099,000
エレコム	16,800	1,325.000	22,260,000
パナソニック	777,600	1,242.500	966,168,000
シャープ	83,300	1,270.000	105,791,000
アンリツ	46,900	1,765.000	82,778,500
富士通ゼネラル	19,900	2,580.000	51,342,000
ソニーグループ	456,500	13,825.000	6,311,112,500
T D K	105,500	4,500.000	474,750,000
帝国通信工業	5,000	1,225.000	6,125,000
タムラ製作所	29,100	689.000	20,049,900
アルプスアルパイン	65,100	1,023.000	66,597,300
日本電波工業	8,200	1,684.000	13,808,800
メイコー	6,000	3,870.000	23,220,000
日本トリム	2,100	3,360.000	7,056,000
ローランド ディー . ジー .	4,800	2,584.000	12,403,200
フオスタ - 電機	9,800	703.000	6,889,400
S M K	2,500	2,281.000	5,702,500
ヨコオ	5,500	2,684.000	14,762,000
ホシデン	17,400	1,174.000	20,427,600
ヒロセ電機	11,200	19,050.000	213,360,000
日本航空電子	17,000	1,815.000	30,855,000
T O A	9,800	725.000	7,105,000

マクセル	15,000	1,309.000	19,635,000
古野電気	9,600	1,146.000	11,001,600
ユニデンホールディングス	2,100	3,350.000	7,035,000
スミダコーポレーション	7,900	1,122.000	8,863,800
アイコム	3,400	2,310.000	7,854,000
リオン	3,600	2,135.000	7,686,000
横河電機	73,100	2,135.000	156,068,500
新電元工業	3,100	3,380.000	10,478,000
アズビル	42,700	5,020.000	214,354,000
東亜ディーケーケー	5,400	840.000	4,536,000
日本光電工業	29,900	3,345.000	100,015,500
共和電業	16,200	388.000	6,285,600
日本電子材料	4,000	2,194.000	8,776,000
堀場製作所	13,400	6,750.000	90,450,000
アドバンテスト	54,100	9,990.000	540,459,000
エスペック	6,200	2,103.000	13,038,600
キーエンス	66,000	70,330.000	4,641,780,000
日置電機	3,500	8,860.000	31,010,000
シスメックス	61,600	14,160.000	872,256,000
日本マイクロニクス	13,100	1,794.000	23,501,400
メガチップス	6,900	4,755.000	32,809,500
OBARA GROUP	3,700	3,320.000	12,284,000
コーセル	10,600	898.000	9,518,800
イリソ電子工業	6,300	4,575.000	28,822,500
オプテックスグループ	12,700	1,485.000	18,859,500
千代田インテグレ	4,000	2,169.000	8,676,000
レーザーテック	32,000	29,745.000	951,840,000
スタンレー電気	50,900	2,952.000	150,256,800
岩崎電気	3,600	2,246.000	8,085,600
ウシオ電機	37,600	2,107.000	79,223,200
日本セラミック	6,900	2,862.000	19,747,800
遠藤照明	4,800	1,023.000	4,910,400
古河電池	5,600	1,463.000	8,192,800
山一電機	6,100	2,305.000	14,060,500
図研	4,800	3,735.000	17,928,000
日本電子	15,200	9,470.000	143,944,000
カシオ	53,000	1,474.000	78,122,000
ファナック	64,000	22,245.000	1,423,680,000
日本シイエムケイ	18,200	504.000	9,172,800
エンブラス	2,200	2,521.000	5,546,200
大真空	11,600	1,570.000	18,212,000
ローム	32,600	10,630.000	346,538,000
浜松ホトニクス	52,200	6,980.000	364,356,000
三井ハイテック	7,200	9,160.000	65,952,000
新光電気工業	21,300	5,350.000	113,955,000
京セラ	102,600	6,731.000	690,600,600
太陽誘電	35,300	6,260.000	220,978,000
村田製作所	214,000	8,380.000	1,793,320,000

双葉電子工業	14,500	689.000	9,990,500
北陸電気工業	6,100	1,266.000	7,722,600
ニチコン	23,100	1,162.000	26,842,200
日本ケミコン	7,300	1,801.000	13,147,300
K O A	11,200	1,530.000	17,136,000
市光工業	10,700	496.000	5,307,200
小糸製作所	39,900	6,530.000	260,547,000
ミツバ	15,600	459.000	7,160,400
S C R E E Nホールディングス	12,700	11,500.000	146,050,000
キャノン電子	7,700	1,486.000	11,442,200
キャノン	362,000	2,500.000	905,000,000
リ コ ー	202,300	1,003.000	202,906,900
象印マホービン	19,700	1,591.000	31,342,700
東京エレクトロン	46,200	59,840.000	2,764,608,000
トヨタ紡織	29,600	2,239.000	66,274,400
ユニプレス	12,600	710.000	8,946,000
豊田自動織機	58,900	9,320.000	548,948,000
モリタホールディングス	12,400	1,273.000	15,785,200
三桜工業	11,100	937.000	10,400,700
デンソー	160,500	8,331.000	1,337,125,500
東海理化電機	19,300	1,484.000	28,641,200
川崎重工業	53,200	1,908.000	101,505,600
日本車輛	3,600	2,008.000	7,228,800
三菱ロジスネクスト	10,600	1,027.000	10,886,200
日産自動車	859,200	562.900	483,643,680
いすゞ自動車	228,500	1,532.000	350,062,000
トヨタ自動車	3,691,100	2,001.000	7,385,891,100
日野自動車	91,500	944.000	86,376,000
三菱自動車工業	269,900	366.000	98,783,400
武蔵精密工業	16,400	1,772.000	29,060,800
日産車体	12,700	676.000	8,585,200
新明和工業	20,300	845.000	17,153,500
極東開発工業	13,400	1,402.000	18,786,800
トピー工業	7,900	1,051.000	8,302,900
ティラド	2,500	2,855.000	7,137,500
曙ブレーキ	44,800	194.000	8,691,200
タチエス	13,300	1,144.000	15,215,200
N O K	36,000	1,214.000	43,704,000
フタバ産業	20,800	385.000	8,008,000
K Y B	7,500	2,904.000	21,780,000
大同メタル工業	18,400	568.000	10,451,200
プレス工業	39,700	373.000	14,808,100
太平洋工業	15,600	1,051.000	16,395,600
アイシン	53,100	4,170.000	221,427,000
マ ッ ダ	228,800	918.000	210,038,400
本田技研	573,800	3,101.000	1,779,353,800
スズキ	166,500	4,585.000	763,402,500
S U B A R U	208,700	2,142.500	447,139,750

安永	5,000	963.000	4,815,000
ヤマハ発動機	95,000	2,859.000	271,605,000
T B K	14,500	393.000	5,698,500
エクセディ	10,900	1,610.000	17,549,000
豊田合成	23,500	2,269.000	53,321,500
愛三工業	13,400	761.000	10,197,400
ヨロズ	8,900	1,054.000	9,380,600
エフ・シー・シー	11,800	1,436.000	16,944,800
シマノ	29,400	31,400.000	923,160,000
テイ・エス テック	30,800	1,333.000	41,056,400
ジャムコ	6,300	827.000	5,210,100
テルモ	206,300	4,628.000	954,756,400
日機装	21,700	848.000	18,401,600
日本エム・ディ・エム	4,700	1,936.000	9,099,200
島津製作所	93,500	4,810.000	449,735,000
J M S	8,100	590.000	4,779,000
長野計器	5,900	1,691.000	9,976,900
ブイ・テクノロジ	3,400	3,445.000	11,713,000
東京計器	6,800	969.000	6,589,200
インターアクション	3,900	2,325.000	9,067,500
東京精密	12,200	4,800.000	58,560,000
マニー	29,600	1,660.000	49,136,000
ニコン	111,700	1,177.000	131,470,900
トプコン	34,700	1,791.000	62,147,700
オリンパス	382,700	2,539.000	971,675,300
理研計器	5,700	5,370.000	30,609,000
タムロン	5,700	2,523.000	14,381,100
H O Y A	142,300	18,020.000	2,564,246,000
ノーリツ鋼機	6,700	2,743.000	18,378,100
エー・アンド・デイ	7,600	1,118.000	8,496,800
朝日インテック	80,100	2,488.000	199,288,800
シチズン時計	83,800	519.000	43,492,200
リズム	3,400	1,190.000	4,046,000
メニコン	24,000	3,755.000	90,120,000
松風	3,600	2,027.000	7,297,200
セイコーHD	10,100	2,198.000	22,199,800
ニプロ	55,600	1,075.000	59,770,000
スノーピーク	9,600	3,875.000	37,200,000
パラマウントベッドHD	14,000	1,931.000	27,034,000
トランザクション	5,500	967.000	5,318,500
ニホンフラッシュ	7,200	1,065.000	7,668,000
前田工織	8,000	3,510.000	28,080,000
永大産業	20,500	272.000	5,576,000
アートネイチャー	9,300	646.000	6,007,800
バンダイナムコHLDGS	65,300	8,837.000	577,056,100
S H O E I	7,200	4,800.000	34,560,000
フランスベッドHLDGS	12,400	853.000	10,577,200
パイロットコーポレーション	12,700	4,145.000	52,641,500

萩原工業	5,800	1,326.000	7,690,800
フジシールインターナショナル	17,700	2,058.000	36,426,600
タカラトミー	31,000	999.000	30,969,000
広済堂ホールディングス	5,400	819.000	4,422,600
プロネクサス	7,600	1,015.000	7,714,000
大建工業	4,600	2,158.000	9,926,800
凸版印刷	110,400	1,723.000	190,219,200
大日本印刷	86,000	2,663.000	229,018,000
共同印刷	3,100	2,761.000	8,559,100
N I S S H A	15,200	1,578.000	23,985,600
T A K A R A & C O M P A N Y	4,800	1,731.000	8,308,800
アシックス	64,700	2,818.000	182,324,600
ローランド	5,200	4,330.000	22,516,000
ヤマハ	43,300	5,820.000	252,006,000
河合楽器	2,400	3,210.000	7,704,000
ピジョン	44,300	2,301.000	101,934,300
キングジム	8,400	853.000	7,165,200
リンテック	15,800	2,500.000	39,500,000
イトーキ	19,700	342.000	6,737,400
任 天 堂	41,200	50,100.000	2,064,120,000
三菱鉛筆	12,100	1,213.000	14,677,300
タカラスタンダ - ド	16,400	1,366.000	22,402,400
コ ク ヨ	35,100	1,656.000	58,125,600
ナカバヤシ	11,400	499.000	5,688,600
グローブライド	6,500	3,460.000	22,490,000
オカムラ	26,700	1,275.000	34,042,500
美 津 濃	7,400	2,131.000	15,769,400
東京電力H D	545,700	303.000	165,347,100
中部電力	221,000	1,146.000	253,266,000
関西電力	275,500	1,027.000	282,938,500
中国電力	113,700	891.000	101,306,700
北陸電力	68,200	563.000	38,396,600
東北電力	168,000	786.000	132,048,000
四国電力	66,500	755.000	50,207,500
九州電力	147,800	811.000	119,865,800
北海道電力	64,200	469.000	30,109,800
沖縄電力	15,500	1,389.000	21,529,500
電源開発	62,100	1,445.000	89,734,500
エフオン	6,400	655.000	4,192,000
イーレックス	10,900	2,558.000	27,882,200
レノバ	14,200	5,350.000	75,970,000
東京瓦斯	139,300	1,945.000	270,938,500
大阪瓦斯	131,100	1,827.000	239,519,700
東邦瓦斯	33,400	3,205.000	107,047,000
北海道瓦斯	5,500	1,471.000	8,090,500
広島ガス	20,400	351.000	7,160,400
西部ガスH L D G S	8,400	2,120.000	17,808,000
静岡ガス	18,800	968.000	18,198,400

メタウォーター	8,500	1,950.000	16,575,000
SBSホールディングス	5,200	3,465.000	18,018,000
東武鉄道	70,300	2,565.000	180,319,500
相鉄ホールディングス	23,700	1,975.000	46,807,500
東急	182,900	1,571.000	287,335,900
京浜急行	93,300	1,122.000	104,682,600
小田急電鉄	107,700	2,187.000	235,539,900
京王電鉄	37,700	5,110.000	192,647,000
京成電鉄	50,700	3,110.000	157,677,000
富士急行	8,800	4,105.000	36,124,000
新京成電鉄	3,500	1,970.000	6,895,000
東日本旅客鉄道	128,400	6,986.000	897,002,400
西日本旅客鉄道	88,400	4,898.000	432,983,200
東海旅客鉄道	60,700	15,600.000	946,920,000
西武ホールディングス	95,600	1,085.000	103,726,000
鴻池運輸	11,900	1,089.000	12,959,100
西日本鉄道	20,500	2,544.000	52,152,000
ハマキョウレックス	5,200	2,850.000	14,820,000
サカイ引越センター	3,300	4,195.000	13,843,500
近鉄グループHLDGS	68,400	3,260.000	222,984,000
阪急阪神HLDGS	85,700	3,365.000	288,380,500
南海電鉄	31,500	2,032.000	64,008,000
京阪ホールディングス	30,800	2,548.000	78,478,400
神戸電鉄	2,800	3,205.000	8,974,000
名古屋鉄道	56,500	1,660.000	93,790,000
山陽電鉄	6,700	1,930.000	12,931,000
日本通運	23,800	6,470.000	153,986,000
ヤマトホールディングス	96,600	2,504.000	241,886,400
山九	19,100	4,510.000	86,141,000
丸全昭和運輸	5,700	3,165.000	18,040,500
センコーグループHLDGS	33,200	926.000	30,743,200
トナミホールディングス	1,900	3,520.000	6,688,000
ニッコンホールディングス	23,700	1,983.000	46,997,100
福山通運	11,200	3,760.000	42,112,000
セイノーホールディングス	46,600	1,147.000	53,450,200
神奈川中央交通	2,500	3,220.000	8,050,000
日立物流	13,600	4,630.000	62,968,000
丸和運輸機関	14,300	1,380.000	19,734,000
C&Fロジホールディングス	7,800	1,502.000	11,715,600
九州旅客鉄道	53,700	2,395.000	128,611,500
SGホールディングス	130,400	2,510.000	327,304,000
日本郵船	57,500	7,400.000	425,500,000
商船三井	38,100	6,500.000	247,650,000
川崎汽船	21,300	4,870.000	103,731,000
NSユニテッド海運	4,000	3,230.000	12,920,000
明治海運	9,300	686.000	6,379,800
飯野海運	33,000	517.000	17,061,000
乾汽船	5,300	2,009.000	10,647,700



日本航空	158,600	2,056.000	326,081,600
ANAホールディングス	175,600	2,239.500	393,256,200
トランコム	2,000	8,050.000	16,100,000
日新	6,300	1,523.000	9,594,900
三菱倉庫	22,100	2,774.000	61,305,400
三井倉庫HOLD	7,500	2,280.000	17,100,000
住友倉庫	23,700	1,817.000	43,062,900
渋沢倉庫	4,600	2,097.000	9,646,200
東陽倉庫	19,900	305.000	6,069,500
日本トランスシティ	16,400	554.000	9,085,600
川西倉庫	3,500	1,067.000	3,734,500
安田倉庫	7,400	930.000	6,882,000
東洋埠頭	5,900	1,407.000	8,301,300
上組	37,300	2,099.000	78,292,700
近鉄エクスプレス	12,700	2,728.000	34,645,600
エーアイティー	5,900	1,139.000	6,720,100
内外トランスライン	3,200	1,826.000	5,843,200
日本コンセプト	3,000	1,644.000	4,932,000
NECネットエスアイ	23,200	1,809.000	41,968,800
システナ	101,200	472.000	47,766,400
デジタルアーツ	3,900	9,430.000	36,777,000
日鉄ソリューションズ	10,100	3,440.000	34,744,000
コア	4,000	1,530.000	6,120,000
ラクーンホールディングス	6,000	1,533.000	9,198,000
ソリトンシステムズ	5,000	1,197.000	5,985,000
ソフトクリエイトHD	3,300	4,385.000	14,470,500
TIS	68,100	3,510.000	239,031,000
グリー	44,100	998.000	44,011,800
コーエーテクモHD	22,800	4,755.000	108,414,000
三菱総合研究所	3,100	3,710.000	11,501,000
ファインデックス	8,700	1,014.000	8,821,800
ブレインパッド	2,000	5,640.000	11,280,000
KLab	15,400	556.000	8,562,400
ポルトゥウィン・ピットクル	11,600	964.000	11,182,400
ネクソン	161,400	2,254.000	363,795,600
アイスタイル	26,000	275.000	7,150,000
エムアップホールディングス	2,300	4,300.000	9,890,000
エイチーム	5,900	1,058.000	6,242,200
エニグモ	8,900	975.000	8,677,500
コロブラ	24,400	693.000	16,909,200
ブロードリーフ	37,100	480.000	17,808,000
デジタルハーツHLDGS	4,200	2,478.000	10,407,600
システム情報	7,000	880.000	6,160,000
メディアドゥ	2,700	4,575.000	12,352,500
じげん	25,200	309.000	7,786,800
バイキューブ	7,800	1,135.000	8,853,000
フィックスターズ	10,600	831.000	8,808,600
CARTA HOLDINGS	3,500	2,130.000	7,455,000

オブティム	6,000	1,437.000	8,622,000
セレス	3,000	2,252.000	6,756,000
S H I F T	3,600	25,320.000	91,152,000
ティーガイア	7,000	1,616.000	11,312,000
テクマトリックス	12,600	1,955.000	24,633,000
ガンホー・オンライン・エンター	19,800	3,040.000	60,192,000
GMOペイメントゲートウェイ	13,900	15,230.000	211,697,000
システムリサーチ	3,100	1,826.000	5,660,600
インターネットイニシアティブ	19,100	4,860.000	92,826,000
さくらインターネット	12,800	531.000	6,796,800
GMOグローバルサインHD	1,800	3,995.000	7,191,000
S R Aホールディングス	4,200	2,758.000	11,583,600
e B A S E	10,200	644.000	6,568,800
アバント	8,300	1,341.000	11,130,300
アドソル日進	3,700	1,708.000	6,319,600
フリービット	5,300	1,220.000	6,466,000
コムチュア	8,000	3,535.000	28,280,000
アステリア	7,900	803.000	6,343,700
アイル	4,400	1,551.000	6,824,400
マークライنز	4,100	2,648.000	10,856,800
メディカル・データ・ビジ	10,000	1,329.000	13,290,000
g u m i	11,000	816.000	8,976,000
テラスカイ	3,300	2,049.000	6,761,700
デジタル・インフォメーション	4,300	1,391.000	5,981,300
P C Iホールディングス	5,900	1,140.000	6,726,000
P R T I M E S	1,700	3,185.000	5,414,500
ラクス	24,700	3,070.000	75,829,000
ダブルスタンダード	2,400	3,745.000	8,988,000
オープンドア	4,700	1,827.000	8,586,900
アカツキ	3,500	2,738.000	9,583,000
U B I C O Mホールディングス	2,500	2,860.000	7,150,000
カナミックネットワーク	10,600	491.000	5,204,600
チェンジ	13,200	2,110.000	27,852,000
オークネット	4,500	1,686.000	7,587,000
マクロミル	17,500	919.000	16,082,500
オロ	2,600	3,400.000	8,840,000
ユーザーローカル	3,400	1,626.000	5,528,400
マネーフォワード	10,900	7,820.000	85,238,000
電算システムHD	3,300	2,255.000	7,441,500
プロトコーポレーション	8,600	1,271.000	10,930,600
野村総合研究所	138,100	4,880.000	673,928,000
インテージホールディングス	9,300	1,751.000	16,284,300
ソースネクスト	37,900	185.000	7,011,500
インフォコム	8,100	1,909.000	15,462,900
シンプレクスHD	7,400	2,790.000	20,646,000
H E R O Z	2,400	1,440.000	3,456,000
ラクスル	7,900	6,260.000	49,454,000
I P S	2,700	2,022.000	5,459,400

イーソル	6,500	666.000	4,329,000
アルテリア・ネットワークス	9,800	1,539.000	15,082,200
ウイングアーク1ST	4,700	2,100.000	9,870,000
サーバーワークス	1,400	3,650.000	5,110,000
Sansan	25,600	3,130.000	80,128,000
ギフトィ	6,500	2,592.000	16,848,000
ベース	1,500	4,175.000	6,262,500
フォーカスシステムズ	7,200	1,023.000	7,365,600
クレスコ	6,100	1,920.000	11,712,000
フジ・メディア・HD	69,200	1,128.000	78,057,600
オービック	22,500	20,990.000	472,275,000
ジャストシステム	10,200	5,190.000	52,938,000
TDCソフト	7,400	1,193.000	8,828,200
Zホールディングス	1,040,900	752.000	782,756,800
トレンドマイクロ	38,300	6,550.000	250,865,000
日本オラクル	14,600	11,160.000	162,936,000
アルファシステムズ	2,100	3,810.000	8,001,000
フューチャー	7,400	4,055.000	30,007,000
CAC HOLDINGS	5,300	1,497.000	7,934,100
SBテクノロジー	3,600	2,696.000	9,705,600
オービックビジネスC	6,800	5,100.000	34,680,000
伊藤忠テクノソリューションズ	32,500	3,695.000	120,087,500
アイティフォー	10,400	792.000	8,236,800
大塚商会	38,600	5,190.000	200,334,000
サイボウズ	9,800	2,163.000	21,197,400
電通国際情報サービス	10,200	3,680.000	37,536,000
ACCESS	10,500	763.000	8,011,500
デジタルガレージ	11,900	4,980.000	59,262,000
イーエムシステムズ	14,800	695.000	10,286,000
ウェザーニューズ	2,200	9,620.000	21,164,000
CIJ	7,300	805.000	5,876,500
WOWOW	4,000	2,034.000	8,136,000
スカラ	10,300	608.000	6,262,400
IMAGICA GROUP	7,300	787.000	5,745,100
ネットワンシステムズ	27,300	3,410.000	93,093,000
アルゴグラフィックス	5,700	2,841.000	16,193,700
マーベラス	14,300	716.000	10,238,800
エイベックス	13,000	1,695.000	22,035,000
日本ユニシス	22,500	3,280.000	73,800,000
兼松エレクトロニクス	3,900	3,600.000	14,040,000
都築電気	4,400	1,722.000	7,576,800
TBSホールディングス	43,700	1,715.000	74,945,500
日本テレビHD	59,800	1,150.000	68,770,000
朝日放送グループHD	10,900	682.000	7,433,800
テレビ朝日HD	17,600	1,492.000	26,259,200
スカパーJSATHD	60,700	405.000	24,583,500
テレビ東京HD	5,800	2,027.000	11,756,600
ビジョン	12,700	1,319.000	16,751,300

USEN - NEXT HLDGS	7,000	3,235.000	22,645,000
コネクシオ	5,700	1,407.000	8,019,900
日本電信電話	836,500	3,125.000	2,614,062,500
KDDI	521,600	3,300.000	1,721,280,000
ソフトバンク	1,083,900	1,562.500	1,693,593,750
光通信	8,400	16,460.000	138,264,000
エムティーアイ	10,400	584.000	6,073,600
GMOインターネット	25,700	2,858.000	73,450,600
ファイバーゲート	3,400	1,079.000	3,668,600
KADOKAWA	21,000	6,020.000	126,420,000
学研ホールディングス	11,100	978.000	10,855,800
ゼンリン	13,600	935.000	12,716,000
アイネット	5,800	1,300.000	7,540,000
松竹	4,900	10,960.000	53,704,000
東宝	42,200	5,050.000	213,110,000
東映	2,300	18,600.000	42,780,000
NTTデータ	190,000	2,394.000	454,860,000
ピー・シー・エー	4,900	1,463.000	7,168,700
ビジネスB太田昭和	3,300	1,964.000	6,481,200
DTS	13,100	2,367.000	31,007,700
スクウェア・エニックス・HD	33,300	5,930.000	197,469,000
シーイーシー	8,800	1,242.000	10,929,600
カプコン	67,400	2,829.000	190,674,600
アイ・エス・ピー	4,700	1,013.000	4,761,100
ジャステック	5,900	1,018.000	6,006,200
SCSK	49,600	2,155.000	106,888,000
日本システムウエア	3,300	2,152.000	7,101,600
アイネス	7,600	1,390.000	10,564,000
TKC	11,900	3,290.000	39,151,000
富士ソフト	7,600	5,280.000	40,128,000
NSD	22,800	2,117.000	48,267,600
コナミホールディングス	26,100	5,810.000	151,641,000
福井コンピュータHLD S	3,700	3,820.000	14,134,000
JBC Cホールディングス	5,900	1,763.000	10,401,700
ミロク情報サービス	7,600	1,464.000	11,126,400
ソフトバンクグループ	429,100	6,030.000	2,587,473,000
伊藤忠食品	2,000	4,905.000	9,810,000
エレマテック	7,000	1,009.000	7,063,000
あらた	5,600	3,850.000	21,560,000
トーメンデバイス	1,200	6,720.000	8,064,000
東京エレクトロンデバイス	2,100	6,770.000	14,217,000
フィールズ	10,000	532.000	5,320,000
双日	78,900	1,606.000	126,713,400
アルフレッサホールディングス	79,700	1,538.000	122,578,600
横浜冷凍	21,500	803.000	17,264,500
アルコニックス	7,900	1,175.000	9,282,500
神戸物産	55,700	4,280.000	238,396,000
あいホールディングス	10,600	1,938.000	20,542,800

ダイワボウHD	34,800	1,809.000	62,953,200
マクニカ・富士エレHLDGS	16,900	2,558.000	43,230,200
ラクト・ジャパン	2,800	2,336.000	6,540,800
グリムス	3,300	2,525.000	8,332,500
バイタルKSKHD	14,700	765.000	11,245,500
八洲電機	8,400	900.000	7,560,000
レスターホールディングス	6,600	1,852.000	12,223,200
ジュテックHD	3,100	1,033.000	3,202,300
TOKAIホールディングス	33,600	826.000	27,753,600
三洋貿易	8,900	969.000	8,624,100
ビューティガレージ	1,500	3,735.000	5,602,500
ウイン・パートナーズ	5,600	940.000	5,264,000
シップヘルスケアHD	22,900	2,530.000	57,937,000
コメダホールディングス	16,300	1,944.000	31,687,200
アセンテック	3,700	1,167.000	4,317,900
フルサト・マルカHD	7,100	1,999.000	14,192,900
ヤマエグループHD	6,200	1,003.000	6,218,600
小野建	7,300	1,572.000	11,475,600
佐島電機	6,200	931.000	5,772,200
伯東	4,800	2,225.000	10,680,000
コンドーテック	7,600	960.000	7,296,000
ナガイレーベン	9,800	2,342.000	22,951,600
三菱食品	6,400	2,690.000	17,216,000
松田産業	5,300	2,701.000	14,315,300
第一興商	13,900	3,580.000	49,762,000
メディパルHD	77,100	2,040.000	157,284,000
SPK	5,300	1,300.000	6,890,000
萩原電気HLDGS	3,500	1,992.000	6,972,000
アズワン	5,100	14,050.000	71,655,000
尾家産業	5,000	1,046.000	5,230,000
シモジマ	6,300	1,079.000	6,797,700
ドウシシャ	7,500	1,468.000	11,010,000
高速	5,200	1,473.000	7,659,600
丸文	8,600	856.000	7,361,600
ハピネット	6,900	1,429.000	9,860,100
日本ライフライン	21,900	1,058.000	23,170,200
タカショー	7,400	715.000	5,291,000
IDOM	22,500	689.000	15,502,500
進和	5,000	1,940.000	9,700,000
ダイトロン	3,600	2,014.000	7,250,400
シークス	11,100	1,331.000	14,774,100
オーハシテクニカ	5,400	1,469.000	7,932,600
白銅	2,800	2,355.000	6,594,000
伊藤忠	501,700	3,260.000	1,635,542,000
丸紅	706,900	1,017.500	719,270,750
長瀬産業	39,200	1,683.000	65,973,600
蝶理	4,800	1,712.000	8,217,600
豊田通商	71,900	4,955.000	356,264,500

三共生興	12,800	547.000	7,001,600
兼 松	25,500	1,231.000	31,390,500
三井物産	557,000	2,557.000	1,424,249,000
日本紙パルプ	3,900	3,575.000	13,942,500
カメイ	8,800	992.000	8,729,600
スターゼン	5,900	1,844.000	10,879,600
山 善	28,600	972.000	27,799,200
椿本興業	1,800	3,880.000	6,984,000
住友商事	452,500	1,546.000	699,565,000
内田洋行	3,200	4,635.000	14,832,000
三菱商事	537,700	3,391.000	1,823,340,700
第一実業	3,300	4,890.000	16,137,000
キャノンマーケティングJPN	17,700	2,200.000	38,940,000
西華産業	5,200	1,507.000	7,836,400
佐藤商事	6,900	1,063.000	7,334,700
菱洋エレクトロ	5,400	2,249.000	12,144,600
東京産業	8,500	739.000	6,281,500
ユアサ商事	6,600	2,797.000	18,460,200
神鋼商事	2,000	3,145.000	6,290,000
阪和興業	14,100	3,070.000	43,287,000
正栄食品	4,600	3,775.000	17,365,000
カナデン	7,700	986.000	7,592,200
菱電商事	6,500	1,677.000	10,900,500
岩谷産業	17,100	5,730.000	97,983,000
ナイス	3,000	1,612.000	4,836,000
極東貿易	2,700	2,332.000	6,296,400
アステナホールディングス	12,100	486.000	5,880,600
三愛石油	17,700	1,184.000	20,956,800
稲畑産業	14,700	1,529.000	22,476,300
G S Iクレオス	5,400	1,021.000	5,513,400
明和産業	7,000	819.000	5,733,000
ワ キ タ	15,600	1,026.000	16,005,600
東邦ホールディングス	23,000	1,692.000	38,916,000
サンゲツ	20,200	1,519.000	30,683,800
ミツウロコグループ	10,900	1,165.000	12,698,500
シナネンホールディングス	3,000	3,420.000	10,260,000
伊藤忠エネクス	14,900	951.000	14,169,900
サンリオ	22,600	2,479.000	56,025,400
サンワ テクノス	5,100	1,675.000	8,542,500
リョーサン	8,100	2,108.000	17,074,800
新光商事	12,700	873.000	11,087,100
トーヨー	5,200	1,375.000	7,150,000
三信電気	4,400	1,395.000	6,138,000
東陽テクニカ	8,700	1,077.000	9,369,900
モスフード サービス	9,400	3,055.000	28,717,000
加賀電子	6,500	2,932.000	19,058,000
ソーダニツカ	10,900	676.000	7,368,400
立花エレテック	6,200	1,519.000	9,417,800

PAL TAC	10,100	4,405.000	44,490,500
太平洋興発	7,700	591.000	4,550,700
西本W I S M E T T A C H D	2,000	3,220.000	6,440,000
コア商事H L D G S	7,700	593.000	4,566,100
国際紙パルプ商事	17,800	311.000	5,535,800
ヤマタネ	4,700	1,516.000	7,125,200
日鉄物産	4,900	4,605.000	22,564,500
泉州電業	2,200	4,590.000	10,098,000
トラスコ中山	14,500	2,631.000	38,149,500
オートバックスセブン	24,800	1,309.000	32,463,200
モリト	9,500	641.000	6,089,500
加藤産業	9,700	3,170.000	30,749,000
イノテック	5,500	1,354.000	7,447,000
イエローハット	12,200	1,550.000	18,910,000
J Kホールディングス	6,800	1,030.000	7,004,000
日 伝	6,000	2,180.000	13,080,000
杉本商事	4,200	2,090.000	8,778,000
因幡電機産業	18,600	2,459.000	45,737,400
東 テ ク	3,000	2,325.000	6,975,000
ミスミグループ本社	90,000	4,785.000	430,650,000
タキヒヨー	3,800	1,690.000	6,422,000
スズケン	28,200	3,085.000	86,997,000
ジェコス	7,500	768.000	5,760,000
ローソン	15,900	5,540.000	88,086,000
サンエー	5,000	3,990.000	19,950,000
カワチ薬品	5,900	2,159.000	12,738,100
エービーシー・マート	11,100	5,340.000	59,274,000
アスクル	11,900	1,419.000	16,886,100
ゲオホールディングス	10,200	1,189.000	12,127,800
アダストリア	7,900	1,863.000	14,717,700
くら寿司	7,500	3,740.000	28,050,000
キャンドウ	3,900	2,315.000	9,028,500
パルグループH L D G S	7,000	1,546.000	10,822,000
エディオン	30,800	999.000	30,769,200
サーラコーポレーション	16,500	569.000	9,388,500
ハローズ	3,400	2,647.000	8,999,800
フジオフードG本社	7,900	1,344.000	10,617,600
あみやき亭	2,700	2,870.000	7,749,000
大黒天物産	2,400	6,120.000	14,688,000
ハニーズホールディングス	7,100	1,000.000	7,100,000
アルペン	5,700	2,174.000	12,391,800
クオールホールディングス	9,300	1,381.000	12,843,300
ジンスホールディングス	5,000	6,450.000	32,250,000
ビックカメラ	41,500	937.000	38,885,500
D C Mホールディングス	43,300	1,051.000	45,508,300
MonotaRO	90,900	2,256.000	205,070,400
アーランドサービスHD	6,100	2,254.000	13,749,400
J . フロント リテイリング	86,300	932.000	80,431,600

ドトール・日レスHD	12,200	1,517.000	18,507,400
マツキヨココカラ&カンパニー	44,000	4,450.000	195,800,000
ブロンコビリー	5,100	2,278.000	11,617,800
Z O Z O	49,600	3,615.000	179,304,000
物語コーポレーション	3,800	7,250.000	27,550,000
三越伊勢丹HD	125,500	776.000	97,388,000
ウエルシアHD	37,900	4,025.000	152,547,500
クリエイトSDH	10,200	3,120.000	31,824,000
チムニー	4,800	1,229.000	5,899,200
シュッピン	7,100	973.000	6,908,300
オイシックス・ラ・大地	10,300	3,340.000	34,402,000
ネクステージ	14,400	2,290.000	32,976,000
ジョイフル本田	20,100	1,560.000	31,356,000
鳥貴族ホールディングス	3,600	1,655.000	5,958,000
ホットランド	7,600	1,300.000	9,880,000
すかいらーくHD	93,100	1,469.000	136,763,900
SFPホールディングス	5,100	1,301.000	6,635,100
綿半ホールディングス	7,000	1,215.000	8,505,000
ユナイテッド・スーパーマーケ	19,400	1,000.000	19,400,000
ゴルフダイジェスト・オン	5,000	1,009.000	5,045,000
B E E N O S	4,000	2,732.000	10,928,000
あさひ	6,300	1,284.000	8,089,200
日本調剤	5,200	1,267.000	6,588,400
コスモス薬品	7,200	17,610.000	126,792,000
セブン&アイ・HLDGS	280,900	4,554.000	1,279,218,600
クリエイト・レストランツ・ホール	38,800	680.000	26,384,000
ツルハホールディングス	15,600	12,800.000	199,680,000
サンマルクホールディングス	7,700	1,408.000	10,841,600
トリドールホールディングス	17,700	2,421.000	42,851,700
T O K Y O B A S E	8,300	669.000	5,552,700
J Mホールディングス	5,600	1,722.000	9,643,200
アレンザホールディングス	6,400	1,021.000	6,534,400
串カツ田中HLDGS	2,500	1,933.000	4,832,500
バロックジャパン	7,700	824.000	6,344,800
クスリのアオキHLDGS	7,200	7,190.000	51,768,000
F O O D & L I F E C O M P A N	42,000	4,825.000	202,650,000
メディカルシステムネットワーク	8,600	620.000	5,332,000
ノジマ	11,500	2,225.000	25,587,500
カッパ・クリエイト	11,300	1,327.000	14,995,100
良品計画	82,700	1,835.000	151,754,500
アドヴァングループ	9,400	883.000	8,300,200
アルビス	3,300	2,114.000	6,976,200
G - 7ホールディングス	8,100	1,654.000	13,397,400
イオン北海道	13,200	1,334.000	17,608,800
コジマ	13,400	556.000	7,450,400
コーナン商事	10,300	3,320.000	34,196,000
エコス	3,300	1,748.000	5,768,400
ワタミ	10,400	850.000	8,840,000



パンパシフィックHD	143,500	1,936.000	277,816,000
西松屋チェーン	15,700	1,497.000	23,502,900
ゼンショーホールディングス	35,400	2,581.000	91,367,400
幸楽苑ホールディングス	6,800	1,413.000	9,608,400
サイゼリヤ	10,900	2,926.000	31,893,400
V Tホールディングス	27,900	421.000	11,745,900
フジ・コーポレーション	5,600	1,164.000	6,518,400
ユナイテッドアローズ	7,800	1,903.000	14,843,400
ハイデイ日高	10,300	1,571.000	16,181,300
コロワイド	30,200	1,522.000	45,964,400
壱番屋	5,200	4,435.000	23,062,000
スギホールディングス	14,400	7,140.000	102,816,000
葉王堂ホールディングス	3,900	2,138.000	8,338,200
スクロール	11,900	767.000	9,127,300
ヨンドシーホールディングス	7,600	1,595.000	12,122,000
木曽路	10,000	2,088.000	20,880,000
S R Sホールディングス	14,600	742.000	10,833,200
千趣会	17,900	388.000	6,945,200
リテールパートナーズ	9,600	1,212.000	11,635,200
ケーヨー	15,200	803.000	12,205,600
上新電機	7,800	2,048.000	15,974,400
日本瓦斯	34,900	1,417.000	49,453,300
ロイヤルホールディングス	12,700	1,819.000	23,101,300
いなげや	9,300	1,301.000	12,099,300
チヨダ	12,100	702.000	8,494,200
ライフコーポレーション	6,700	3,355.000	22,478,500
リンガーハット	9,700	2,136.000	20,719,200
Mr Max HD	11,600	529.000	6,136,400
A O K Iホールディングス	15,600	614.000	9,578,400
オークワ	12,500	955.000	11,937,500
コメリ	10,700	2,444.000	26,150,800
青山商事	17,100	719.000	12,294,900
しまむら	8,300	9,700.000	80,510,000
高島屋	52,700	995.000	52,436,500
松屋	15,400	838.000	12,905,200
エイチ・ツー・オーリテイリング	33,200	790.000	26,228,000
近鉄百貨店	3,400	2,428.000	8,255,200
丸井グループ	61,000	2,086.000	127,246,000
アクシアル リテイリング	5,500	3,260.000	17,930,000
イオン	276,100	2,644.500	730,146,450
イズミ	13,100	3,145.000	41,199,500
平和堂	12,500	1,853.000	23,162,500
フジ	8,700	1,920.000	16,704,000
ヤオコー	8,200	6,690.000	54,858,000
ゼビオホールディングス	10,600	879.000	9,317,400
ケーズホールディングス	65,700	1,149.000	75,489,300
日産東京販売HD	21,500	225.000	4,837,500
GENKY DRUG STORES	3,200	5,120.000	16,384,000

ブックオフGHD	5,600	970.000	5,432,000
ギフト	1,600	2,636.000	4,217,600
アインホールディングス	10,600	6,110.000	64,766,000
元気寿司	2,800	2,446.000	6,848,800
ヤマダホールディングス	263,400	396.000	104,306,400
アークランドサカモト	11,500	1,659.000	19,078,500
ニトリホールディングス	28,600	18,030.000	515,658,000
グルメ杵屋	10,800	982.000	10,605,600
吉野家ホールディングス	25,600	2,225.000	56,960,000
松屋フーズHLDGS	3,600	3,430.000	12,348,000
サガミホールディングス	13,700	991.000	13,576,700
関西スーパーマーケット	5,900	1,834.000	10,820,600
王将フードサービス	4,700	5,780.000	27,166,000
プレナス	8,300	1,935.000	16,060,500
ミニストップ	6,600	1,361.000	8,982,600
アークス	13,100	2,067.000	27,077,700
バローホールディングス	15,400	2,116.000	32,586,400
ベルク	3,200	5,260.000	16,832,000
ファーストリテイリング	9,600	67,400.000	647,040,000
サンドラッグ	27,000	2,989.000	80,703,000
ベルーナ	16,700	667.000	11,138,900
めぶきフィナンシャルG	369,600	224.000	82,790,400
東京きらぼしFG	9,700	1,393.000	13,512,100
九州フィナンシャルG	141,400	380.000	53,732,000
ゆうちょ銀行	168,200	928.000	156,089,600
富山第一銀行	16,800	266.000	4,468,800
コンコルディア・フィナンシャル	406,800	413.000	168,008,400
西日本フィナンシャルHD	47,000	682.000	32,054,000
33FG	8,700	1,355.000	11,788,500
第四北越フィナンシャルG	11,700	2,300.000	26,910,000
ひろぎんHLDGS	106,200	622.000	66,056,400
おきなわFG	7,000	2,066.000	14,462,000
十六FG	10,100	1,976.000	19,957,600
北國FHD	7,400	2,114.000	15,643,600
新生銀行	46,700	1,916.000	89,477,200
あおぞら銀行	39,400	2,472.000	97,396,800
三菱UFJフィナンシャルG	4,609,100	601.400	2,771,912,740
りそなホールディングス	822,500	415.600	341,831,000
三井住友トラストHD	135,100	3,560.000	480,956,000
三井住友フィナンシャルG	497,600	3,703.000	1,842,612,800
千葉銀行	240,400	661.000	158,904,400
群馬銀行	133,900	331.000	44,320,900
武蔵野銀行	11,200	1,558.000	17,449,600
七十七銀行	22,900	1,156.000	26,472,400
青森銀行	5,600	1,593.000	8,920,800
秋田銀行	4,300	1,430.000	6,149,000
山形銀行	10,600	811.000	8,596,600
岩手銀行	6,000	1,610.000	9,660,000

東邦銀行	73,100	194.000	14,181,400
東北銀行	4,000	964.000	3,856,000
みちのく銀行	4,500	731.000	3,289,500
ふくおかフィナンシャルG	59,800	1,838.000	109,912,400
静岡銀行	173,800	800.000	139,040,000
スルガ銀行	63,400	471.000	29,861,400
八十二銀行	155,600	356.000	55,393,600
山梨中央銀行	10,800	788.000	8,510,400
大垣共立銀行	14,200	1,771.000	25,148,200
福井銀行	8,000	1,332.000	10,656,000
清水銀行	4,400	1,516.000	6,670,400
富山銀行	2,400	1,696.000	4,070,400
滋賀銀行	13,500	1,751.000	23,638,500
南都銀行	11,600	1,790.000	20,764,000
百五銀行	69,900	318.000	22,228,200
京都銀行	25,500	4,825.000	123,037,500
紀陽銀行	25,100	1,359.000	34,110,900
ほくほくフィナンシャルG	44,600	770.000	34,342,000
山陰合同銀行	43,900	564.000	24,759,600
中国銀行	55,900	836.000	46,732,400
伊予銀行	91,900	524.000	48,155,600
百十四銀行	9,200	1,350.000	12,420,000
四国銀行	13,400	704.000	9,433,600
阿波銀行	11,300	2,035.000	22,995,500
大分銀行	5,500	1,680.000	9,240,000
宮崎銀行	5,400	1,952.000	10,540,800
佐賀銀行	4,500	1,408.000	6,336,000
琉球銀行	18,200	712.000	12,958,400
セブン銀行	210,500	228.000	47,994,000
みずほフィナンシャルG	919,400	1,402.000	1,288,998,800
山口フィナンシャルG	83,100	621.000	51,605,100
名古屋銀行	5,800	2,193.000	12,719,400
北洋銀行	109,800	231.000	25,363,800
愛知銀行	2,900	3,505.000	10,164,500
中京銀行	4,700	1,185.000	5,569,500
愛媛銀行	13,100	720.000	9,432,000
京葉銀行	33,500	422.000	14,137,000
栃木銀行	46,000	174.000	8,004,000
東和銀行	17,400	480.000	8,352,000
トモニホールディングス	60,300	291.000	17,547,300
フィデアホール	8,500	1,197.000	10,174,500
池田泉州HD	94,200	149.000	14,035,800
F P G	26,400	551.000	14,546,400
ジャパンインベストメントA	6,700	1,143.000	7,658,100
S B Iホールディングス	88,200	2,924.000	257,896,800
ジャフコ グループ	9,200	7,120.000	65,504,000
大和証券G本社	538,100	630.900	339,487,290
野村ホールディングス	1,098,600	477.400	524,471,640

岡三証券グループ	56,700	369.000	20,922,300
丸三証券	24,300	499.000	12,125,700
東海東京HD	79,200	372.000	29,462,400
水戸証券	24,700	269.000	6,644,300
いちよし証券	16,300	619.000	10,089,700
松井証券	35,300	781.000	27,569,300
マネックスG	58,600	931.000	54,556,600
極東証券	9,700	732.000	7,100,400
岩井コスモホールディング	8,100	1,292.000	10,465,200
アイザワ証券グループ	12,500	986.000	12,325,000
スパークス・グループ	38,700	312.000	12,074,400
かんぽ生命保険	72,500	1,758.000	127,455,000
S O M P Oホールディングス	126,800	4,674.000	592,663,200
アニコム ホールディングス	22,200	777.000	17,249,400
M S & A D	161,000	3,316.000	533,876,000
第一生命H L D G S	353,900	2,287.000	809,369,300
東京海上HD	236,700	5,708.000	1,351,083,600
T & Dホールディングス	186,200	1,342.000	249,880,400
アドバンスクリエイト	4,000	981.000	3,924,000
全国保証	17,300	4,960.000	85,808,000
ジェイリース	2,800	2,055.000	5,754,000
イントラスト	5,100	725.000	3,697,500
日本モーゲージサービス	4,100	1,038.000	4,255,800
アルヒ	12,200	1,001.000	12,212,200
プレミアグループ	4,200	3,500.000	14,700,000
クレディセゾン	45,800	1,124.000	51,479,200
芙蓉総合リース	7,400	7,180.000	53,132,000
みずほリース	11,100	2,964.000	32,900,400
東京センチュリー	13,700	5,420.000	74,254,000
日本証券金融	29,400	814.000	23,931,600
アイフル	121,500	352.000	42,768,000
リコーリース	6,800	3,615.000	24,582,000
イオンフィナンシャルサービス	38,500	1,227.000	47,239,500
ア コ ム	141,900	337.000	47,820,300
ジャックス	8,200	2,753.000	22,574,600
オ リ コ	196,900	124.000	24,415,600
オリックス	436,700	2,245.000	980,391,500
三菱H C キャピタル	261,000	534.000	139,374,000
日本取引所グループ	181,900	2,459.000	447,292,100
イー・ギャランティ	11,200	2,457.000	27,518,400
N E C キャピタルソリューション	3,400	1,914.000	6,507,600
いちご	83,300	284.000	23,657,200
日本駐車場開発	93,100	136.000	12,661,600
スター・マイカ・H L D G S	5,200	1,239.000	6,442,800
S R Eホールディングス	1,900	9,050.000	17,195,000
ヒューリック	170,800	1,076.000	183,780,800
三栄建築設計	3,900	1,621.000	6,321,900
野村不動産H L D G S	38,100	2,465.000	93,916,500

三重交通グループHD	18,400	456.000	8,390,400
サムティ	10,100	2,286.000	23,088,600
ディア・ライフ	12,800	526.000	6,732,800
日本商業開発	7,000	1,691.000	11,837,000
プレサンスコーポレーション	10,800	1,714.000	18,511,200
日本管理センター	5,600	1,022.000	5,723,200
フージャースHD	13,300	630.000	8,379,000
オープンハウス	22,800	6,440.000	146,832,000
東急不動産HD	210,200	586.000	123,177,200
飯田GH D	60,200	2,348.000	141,349,600
シーアールイー	3,100	1,673.000	5,186,300
ケイアイスター不動産	3,400	8,530.000	29,002,000
グッドコムアセット	4,400	1,209.000	5,319,600
ジェイ・エス・ビー	2,100	2,734.000	5,741,400
パーク24	38,900	1,610.000	62,629,000
パラカ	4,400	1,506.000	6,626,400
宮越ホールディングス	4,300	1,203.000	5,172,900
三井不動産	327,600	2,336.000	765,273,600
三菱地所	471,900	1,565.000	738,523,500
平和不動産	13,000	3,400.000	44,200,000
東京建物	71,000	1,608.000	114,168,000
ダイビル	18,900	1,464.000	27,669,600
京阪神ビルディング	12,900	1,377.000	17,763,300
住友不動産	150,800	3,539.000	533,681,200
テーオーシー	16,200	556.000	9,007,200
東京楽天地	2,100	3,980.000	8,358,000
スターツコーポレーション	10,400	2,429.000	25,261,600
フジ住宅	11,600	664.000	7,702,400
空港施設	13,200	525.000	6,930,000
ゴールドクレスト	6,900	1,492.000	10,294,800
日神グループH L D G S	15,400	465.000	7,161,000
日本エスコン	16,100	750.000	12,075,000
タカラレーベン	37,400	266.000	9,948,400
A V A N T I A	7,800	828.000	6,458,400
イオンモール	35,800	1,607.000	57,530,600
カチタス	18,200	4,190.000	76,258,000
トーセイ	11,500	963.000	11,074,500
サンフロンティア不動産	11,700	958.000	11,208,600
F J ネクストホールディングス	8,800	973.000	8,562,400
日本空港ビルデング	27,500	5,000.000	137,500,000
日本工営	4,300	3,170.000	13,631,000
L I F U L L	27,100	258.000	6,991,800
ミクシィ	16,000	2,021.000	32,336,000
ジェイエイシーリクルートメント	6,100	1,988.000	12,126,800
日本M & Aセンターホールデ メンバーズ	114,500	3,335.000	381,857,500
メンバーズ	2,600	2,333.000	6,065,800
UTグループ	10,100	4,050.000	40,905,000
アイティメディア	3,900	2,006.000	7,823,400

E・Jホールディングス	4,800	1,179.000	5,659,200
夢真ビーネックスグループ	18,800	1,666.000	31,320,800
コシダカホールディングス	19,200	598.000	11,481,600
パソナグループ	7,500	3,545.000	26,587,500
リンクアンドモチベーション	16,600	707.000	11,736,200
エス・エム・エス	23,900	4,235.000	101,216,500
パーソルホールディングス	69,700	3,280.000	228,616,000
リニカル	6,800	851.000	5,786,800
クックパッド	29,600	256.000	7,577,600
スタジオアリス	4,000	2,022.000	8,088,000
シミックホールディングス	5,400	1,546.000	8,348,400
総合警備保障	27,600	4,840.000	133,584,000
カカクコム	51,700	3,175.000	164,147,500
アイロムグループ	3,200	1,709.000	5,468,800
ルネサンス	6,700	1,129.000	7,564,300
ディップ	12,300	3,980.000	48,954,000
デジタルホールディングス	5,400	1,390.000	7,506,000
新日本科学	9,200	1,615.000	14,858,000
ベネフィット・ワン	25,300	5,320.000	134,596,000
エムスリー	123,000	6,119.000	752,637,000
アウトソーシング	40,400	1,504.000	60,761,600
ウェルネット	15,200	449.000	6,824,800
ワールドホールディングス	3,200	2,529.000	8,092,800
ディー・エヌ・エー	27,000	1,680.000	45,360,000
博報堂DYHLDGS	96,800	1,693.000	163,882,400
ぐるなび	14,700	469.000	6,894,300
タカミヤ	14,900	430.000	6,407,000
ジャパンベストレスキューS	5,700	955.000	5,443,500
ファンコミュニケーションズ	23,300	404.000	9,413,200
エスプール	19,800	1,275.000	25,245,000
WDBホールディングス	3,500	3,125.000	10,937,500
手間いらず	1,100	5,160.000	5,676,000
アドウェイズ	11,500	763.000	8,774,500
バリューコマース	5,500	4,520.000	24,860,000
インフォマート	77,100	1,026.000	79,104,600
J Pホールディングス	26,300	245.000	6,443,500
プレステージ・インター	26,800	690.000	18,492,000
アミューズ	4,700	1,895.000	8,906,500
クイック	6,100	1,403.000	8,558,300
電通グループ	71,900	3,610.000	259,559,000
ぴあ	2,800	3,770.000	10,556,000
イオンファンタジー	3,700	1,738.000	6,430,600
シーティーエス	9,800	779.000	7,634,200
HUグループHD	18,600	2,862.000	53,233,200
アルプス技研	6,800	1,870.000	12,716,000
日本空調サービス	10,000	779.000	7,790,000
オリエンタルランド	82,300	17,840.000	1,468,232,000
ダスキン	16,500	2,617.000	43,180,500

明光ネットワークジャパン	12,300	541.000	6,654,300
ファルコホールディングス	4,500	1,693.000	7,618,500
ラウンドワン	19,800	1,309.000	25,918,200
リゾートトラスト	32,500	1,860.000	60,450,000
ビー・エム・エル	9,000	3,530.000	31,770,000
りらいあコミュニケーション	11,500	1,009.000	11,603,500
リソー教育	33,800	405.000	13,689,000
ユー・エス・エス	78,200	1,666.000	130,281,200
東京個別指導学院	8,500	624.000	5,304,000
サイバーエージェント	172,000	2,093.000	359,996,000
楽天グループ	358,300	1,161.000	415,986,300
クリーク・アンド・リバー社	4,200	1,999.000	8,395,800
モーニングスター	16,600	604.000	10,026,400
山田コンサルティングG P	5,000	1,113.000	5,565,000
セントラルスポーツ	3,900	2,343.000	9,137,700
フルキャストホールディングス	6,100	2,648.000	16,152,800
エン・ジャパン	11,300	3,540.000	40,002,000
テクノプロ・ホールディング	41,900	3,120.000	130,728,000
アイ・アールジャパンHD	3,300	7,090.000	23,397,000
Keep Per 技研	4,600	2,574.000	11,840,400
イー・ガーディアン	3,300	3,485.000	11,500,500
ジャパンマテリアル	21,500	1,552.000	33,368,000
ベクトル	10,500	1,249.000	13,114,500
チャームケアコーポレーション	6,000	1,482.000	8,892,000
キャリアリンク	3,400	1,264.000	4,297,600
I B J	7,400	1,020.000	7,548,000
アサンテ	5,200	1,689.000	8,782,800
バリューHR	4,000	2,506.000	10,024,000
M&Aキャピタルパートナー	5,700	5,500.000	31,350,000
ライドオンエクスプレスHD	4,000	1,713.000	6,852,000
ERIホールディングス	2,600	1,386.000	3,603,600
シグマクシス・ホールディング	4,500	2,801.000	12,604,500
ウィルグループ	6,100	1,360.000	8,296,000
メドピア	5,400	3,575.000	19,305,000
リクルートホールディングス	537,400	6,901.000	3,708,597,400
エラン	9,700	1,239.000	12,018,300
日本郵政	910,100	856.000	779,045,600
ベルシステム24HLDGS	10,300	1,255.000	12,926,500
鎌倉新書	9,200	775.000	7,130,000
エアトリ	4,700	3,155.000	14,828,500
アトラエ	5,600	2,481.000	13,893,600
ストライク	2,900	5,660.000	16,414,000
ソラスト	17,300	1,234.000	21,348,200
セラク	2,800	1,758.000	4,922,400
インソース	7,000	2,453.000	17,171,000
ベイカレントコンサルティング	4,900	47,300.000	231,770,000
ORCHESTRA HLDGS	1,800	3,970.000	7,146,000
アイモバイル	2,800	1,281.000	3,586,800

グレイステクノロジー	11,900	422.000	5,021,800
ジャパンエレベーターSHD	21,900	2,125.000	46,537,500
ウェルビー	5,600	1,389.000	7,778,400
エル・ティー・エス	1,300	2,736.000	3,556,800
ミダックホールディングス	3,100	4,965.000	15,391,500
日総工産	7,700	808.000	6,221,600
キュービーネットHLDGS	4,400	1,653.000	7,273,200
RPAホールディングス	12,100	372.000	4,501,200
マネジメントソリューションズ	3,600	3,260.000	11,736,000
カーブスホールディングス	19,700	774.000	15,247,800
ダイレクトマーケティングミクス	4,000	3,840.000	15,360,000
ポピンズホールディング	2,100	3,105.000	6,520,500
LITALICO	5,900	4,190.000	24,721,000
アドバンテッジリスクマネ	5,700	657.000	3,744,900
リログループ	38,600	2,093.000	80,789,800
東祥	6,000	1,674.000	10,044,000
TREホールディングス	9,800	1,775.000	17,395,000
人・夢・技術グループ	3,500	1,813.000	6,345,500
エイチ・アイ・エス	15,600	1,941.000	30,279,600
ラックランド	3,700	2,908.000	10,759,600
共立メンテナンス	12,500	3,995.000	49,937,500
イチネンホールディングス	8,200	1,300.000	10,660,000
建設技術研究所	4,600	2,364.000	10,874,400
燦ホールディングス	4,400	1,386.000	6,098,400
東京テアトル	6,100	1,209.000	7,374,900
ナガワ	2,200	11,420.000	25,124,000
東京都競馬	5,300	3,990.000	21,147,000
カナモト	12,200	2,154.000	26,278,800
西尾レントオール	6,500	2,519.000	16,373,500
トランス・コスモス	9,000	3,150.000	28,350,000
乃村工藝社	30,100	1,003.000	30,190,300
日本管財	7,200	2,736.000	19,699,200
トーカイ	6,100	1,949.000	11,888,900
セコム	68,700	7,664.000	526,516,800
セントラル警備保障	3,900	2,407.000	9,387,300
丹青社	15,500	810.000	12,555,000
メイテック	8,600	6,660.000	57,276,000
応用地質	7,600	1,963.000	14,918,800
船井総研ホールディン	14,400	2,559.000	36,849,600
オオバ	8,100	760.000	6,156,000
ベネッセホールディングス	23,800	2,199.000	52,336,200
イオンディライト	8,500	3,545.000	30,132,500
ダイセキ	12,800	5,160.000	66,048,000
合計	78,890,900		192,569,963,990

## (b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。



デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

2021年12月30日現在

資産総額	31,772,470,252円
負債総額	50,045,414円
純資産総額（ - ）	31,722,424,838円
発行済口数	9,912,070,248口
1口当たり純資産額（ / ）	3.2004円
（1万口当たり純資産額）	（32,004円）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

## イ 名義書換

該当事項はありません。

## ロ 受益者名簿

作成しません。

## ハ 受益者に対する特典

ありません。

## ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

## (イ) 受益権の譲渡

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

## (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

## ホ 受益権の再分割

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

## へ 償還金

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

## ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### イ 資本金の額および株式数

	2021年12月30日現在
資本金の額	20億円
会社が発行する株式の総数	60,000,000株
発行済株式総数	33,870,060株

##### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

#### ハ 会社の機構

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

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

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

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

#### ニ 投資信託の運用の流れ



#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年12月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託(親投資信託は除きます)は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	732	9,624,127
単位型株式投資信託	102	551,334
追加型公社債投資信託	1	27,985
単位型公社債投資信託	189	415,688
合計	1,024	10,619,135

### 3【委託会社等の経理状況】

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

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。

なお、当中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)は、改正府令附則第3条第1項ただし書きにより、改正後の中間財務諸表等規則に基づいて作成しております。

2 当社は、第36期(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任あずさ監査法人の監査を受けており、第37期中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任あずさ監査法人の中間監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	33,264,545	33,048,142
顧客分別金信託	300,021	300,036
前払費用	515,226	449,748
未収入金	602,605	132,419
未収委託者報酬	8,404,880	9,936,096
未収運用受託報酬	2,199,785	2,247,156
未収投資助言報酬	299,826	398,108
未収収益	37,702	39,975

その他の流動資産		40,119	6,981
流動資産合計		45,664,712	46,558,665
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		101,609	1,509,450
器具備品		783,224	870,855
土地		710	710
リース資産		968	13,483
建設仮勘定		66,498	-
有形固定資産合計		953,010	2,394,500
無形固定資産			
ソフトウェア		909,133	1,347,889
ソフトウェア仮勘定		508,733	1,029,033
のれん		34,397,824	3,654,491
顧客関連資産		17,785,166	15,671,890
電話加入権		12,739	12,727
商標権		54	48
無形固定資産合計		53,613,651	21,716,080
投資その他の資産			
投資有価証券		19,436,480	22,866,282
関係会社株式		11,246,398	11,246,398
長期差入保証金		2,523,637	1,409,091
長期前払費用		113,852	116,117
会員権		90,479	90,479
貸倒引当金		20,750	20,750
投資その他の資産合計		33,390,098	35,707,619
固定資産合計		87,956,760	59,818,200
資産合計		133,621,473	106,376,866

(単位：千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
負債の部		
流動負債		
リース債務	1,064	5,153
顧客からの預り金	14,285	20,077
その他の預り金	146,200	169,380
未払金		
未払収益分配金	1,629	1,646
未払償還金	131,338	43,523
未払手数料	3,776,873	4,480,697
その他未払金	502,211	270,290
未払費用	3,935,582	5,940,121
未払消費税等	305,513	235,647
未払法人税等	489,151	762,648
賞与引当金	1,716,321	1,516,622
その他の流動負債	30,951	9,710
流動負債合計	11,051,125	13,455,519
固定負債		
リース債務	-	9,678
繰延税金負債	2,963,538	2,566,958
退職給付引当金	5,299,814	5,258,448
賞与引当金	14,767	-
その他の固定負債	172,918	40,950
固定負債合計	8,451,038	7,876,035

負債合計	19,502,164	21,331,554
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	81,927,000
資本剰余金合計	90,555,984	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	19,364,265	10,281,242
利益剰余金合計	21,185,470	8,460,037
株主資本計	113,741,454	84,095,946
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	377,855	949,365
評価・換算差額等合計	377,855	949,365
純資産合計	114,119,309	85,045,311
負債・純資産合計	133,621,473	106,376,866

## (2) 【損益計算書】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	54,615,133	50,610,457
運用受託報酬	9,389,058	9,450,169
投資助言報酬	1,303,595	1,270,584
その他営業収益		
サービス支 hands 手数料	181,061	200,807
その他	32,421	32,820
営業収益計	65,521,269	61,564,839
営業費用		
支払手数料	24,888,040	22,784,919
広告宣伝費	447,024	365,317
調査費		
調査費	3,214,679	3,061,987
委託調査費	7,702,309	7,810,157
営業雑経費		
通信費	70,007	95,163
印刷費	612,249	554,920
協会費	45,117	40,044
諸会費	32,199	29,473
情報機器関連費	4,349,174	4,562,612
販売促進費	68,688	23,614
その他	154,201	163,332
営業費用合計	41,583,691	39,491,542
一般管理費		
給料		

役員報酬	264,325	277,027
給料・手当	9,789,691	9,280,730
賞与	914,702	950,630
賞与引当金繰入額	1,726,013	1,501,855
交際費	30,898	11,815
寄付金	2,022	949
事務委託費	956,931	844,255
旅費交通費	249,359	21,023
租税公課	389,032	389,819
不動産賃借料	1,121,553	1,639,529
退職給付費用	797,158	790,144
固定資産減価償却費	3,044,658	3,040,894
のれん償却費	2,645,986	2,645,986
諸経費	482,324	608,206
一般管理費合計	22,414,658	22,002,869
営業利益	1,522,919	70,426

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	778,113	13,164
受取利息	947	2,736
時効成立分配金・償還金	1,041	88,335
原稿・講演料	2,061	2,603
投資有価証券償還益	6,398	57,388
投資有価証券売却益	24,206	162,941
雑収入	53,484	72,933
営業外収益合計	866,254	400,104
営業外費用		
為替差損	72,457	766
投資有価証券償還損	129,006	11,762
投資有価証券売却損	12,906	34,473
雑損失	8,334	1,240
営業外費用合計	222,704	48,243
経常利益	2,166,469	422,288
特別損失		
固定資産除却損	1 110,668	54,493
減損損失	2 46,417	28,097,346
合併関連費用	42,800	-
早期退職費用	3 -	216,200
本社移転費用	4 133,168	127,044
その他特別損失	-	5,460
特別損失合計	333,054	28,500,544
税引前当期純利益又は 税引前当期純損失( )	1,833,414	28,078,256
法人税、住民税及び事業税	1,874,278	1,549,173
法人税等調整額	619,676	693,192
法人税等合計	1,254,602	855,980



当期純利益又は  
当期純損失( )

578,811

28,934,237

## (3)【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	23,076,258	33,705,242	594,061	594,061	34,299,304
当期変動額					
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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	19,364,265
当期変動額								
剰余金の配当								711,271
当期純損失( )								28,934,237

株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	-	-	29,645,508
当期末残高	2,000,000	8,628,984	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959		10,281,242

	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	21,185,470	113,741,454	377,855	377,855	114,119,309
当期変動額					
剰余金の配当	711,271	711,271		-	711,271
当期純損失( )	28,934,237	28,934,237		-	28,934,237
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)	-	-	571,510	571,510	571,510
当期変動額合計	29,645,508	29,645,508	571,510	571,510	29,073,997
当期末残高	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311

## [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

市場価格のない株式等以外

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)

市場価格のない株式等

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、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 4～15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、当事業年度において発生していると認められる額を計上しております。

## 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。

## (会計方針の変更)

当社は「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日。以下「時価算定会計基準」という。）及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準第31号 2019年7月4日）を当事業年度の期首から適用し、時価算定会計基準第19項及び「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）第44 - 2項に定める経過的な取扱いに従って、時価算定会計基準等が定める新たな会計方針を、将来にわたって適用することとしました。

## (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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	466,875千円	102,329千円
器具備品	1,225,261千円	1,153,649千円
リース資産	1,452千円	2,830千円

## 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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
Sumitomo Mitsui DS Asset Management (USA) Inc.	132,559千円	93,374千円

## (損益計算書関係)

## 1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
建物	879千円	18,278千円
器具備品	119千円	28,604千円
リース資産	5,377千円	- 千円
ソフトウェア	1,596千円	7,610千円
ソフトウェア仮勘定	102,695千円	- 千円

## 2 減損損失

前事業年度において、次のとおり減損損失を計上しております。

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。

当事業年度において、次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
-	その他	のれん	28,097,346

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。

当社は、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に伴って発生したのれんを計上しております。当該のれんについて下期以降の業績は上向いているものの、通期では業績計画を下回る結果となったことを踏まえて将来キャッシュ・フローを見直した結果、のれんの帳簿価額の回収が見込まれなくなったため、帳簿価額を回収可能価額まで減損し、当該減少額を減損損失として計上しております。

なお、回収可能価額は使用価値としており、将来キャッシュ・フローを9.2%で割り引いて算出しております。

### 3 早期退職費用

早期希望退職の募集等の実施に関連して発生する費用であります。

### 4 本社移転費用

前事業年度の本社移転費用は、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。

当事業年度の本社移転費用は、本社移転に伴うものであり、主に設備撤去費用、引越費用などであります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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	33,870,060株	-	-	33,870,060株

#### 2. 剰余金の配当に関する事項

##### 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
----	-------	----------------	-----------------	-----	-------

2020年6月29日 定時株主総会	普通株式	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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
1年以内	1,618,641	1,194,699
1年超	5,844,934	3,497,258
合計	7,463,576	4,691,958

## (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。

## 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、市場価格のないものは、次表には含まれていません(注2)参照)。

前事業年度(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	-

当事業年度(2021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	33,048,142	33,048,142	-
(2)顧客分別金信託	300,036	300,036	-
(3)未収委託者報酬	9,936,096	9,936,096	-
(4)未収運用受託報酬	2,247,156	2,247,156	-
(5)未収投資助言報酬	398,108	398,108	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	22,826,472	22,826,472	-
(7)長期差入保証金	1,409,091	1,409,091	-
資産計	70,165,105	70,165,105	-
(1)顧客からの預り金	20,077	20,077	-
(2)未払手数料	4,480,697	4,480,697	-
負債計	4,500,774	4,500,774	-

(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)市場価格のない金融商品の貸借対照表計上額

(単位:千円)

区分	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
その他有価証券 非上場株式	45,369	39,809
合計	45,369	39,809
子会社株式 非上場株式	11,246,398	11,246,398
合計	11,246,398	11,246,398

その他有価証券については、市場価格がないため、「(6) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がないため、時価開示の対象とはしておりません。

また時価をもって貸借対照表計上額としている「(6) その他有価証券」は、全て投資信託で構成されております。そのため、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」第26項の経過措置を適用し、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項は記載しておりません。

(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(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	-	-

当事業年度(2021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	33,048,142	-	-	-
顧客分別金信託	300,036	-	-	-
未収委託者報酬	9,936,096	-	-	-
未収運用受託報酬	2,247,156	-	-	-
未収投資助言報酬	398,108	-	-	-
長期差入保証金	42,007	1,367,084	-	-
合計	45,971,548	1,367,084	-	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式

前事業年度(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、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度(2021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、市場価格がないことから、記載しておりません。

2. その他有価証券

前事業年度(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、市場価格がないことから、記載しておりません。

当事業年度(2021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	14,397,606	16,097,433	1,699,827
小計	14,397,606	16,097,433	1,699,827
(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	6,994,762	6,729,039	265,723
小計	6,994,762	6,729,039	265,723
合計	21,392,369	22,826,472	1,434,103

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 39,809千円)については、市場価格がないことから、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 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

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021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
1,978,622	162,941	34,473

(単位：千円)

償還額	償還益の合計額	償還損の合計額
1,630,219	57,388	11,762

#### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、減損処理を行った有価証券はありません。

当事業年度において、投資有価証券について1,560千円（その他有価証券1,560千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

(退職給付関係)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

##### 2. 確定給付制度

###### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,418,601	5,299,814
勤務費用	523,396	476,308
利息費用	-	-
数理計算上の差異の発生額	195	67,476
退職給付の支払額	349,050	585,151
過去勤務費用の発生額	-	-
合併による発生額	1,707,062	-
退職給付債務の期末残高	5,299,814	5,258,448

###### (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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	5,299,814	5,258,448
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	5,299,814	5,258,448

###### (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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
勤務費用	492,511	476,308
利息費用	-	-
数理計算上の差異の費用処理額	195	67,476
その他	304,842	246,359
確定給付制度に係る退職給付費用	797,158	790,144

(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 2019年 4月 1日 至 2020年 3月 31日)	当事業年度 (自 2020年 4月 1日 至 2021年 3月 31日)
割引率	0.000%	0.020%

## 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248,932千円、当事業年度239,162千円であります。

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	(単位：千円)	
	前事業年度 (2020年 3月 31日)	当事業年度 (2021年 3月 31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	1,622,803	1,610,136
賞与引当金	530,059	464,389
調査費	178,573	247,208
未払金	162,557	206,090
未払事業税	46,423	66,891
ソフトウェア償却	91,937	90,431
子会社株式評価損	114,876	114,876
その他有価証券評価差額金	150,771	131,391
その他	88,250	35,930
繰延税金資産小計	2,986,254	2,967,346
評価性引当額(注)	193,485	218,966
繰延税金資産合計	2,792,768	2,748,380
繰延税金負債		
無形固定資産	5,445,817	4,798,732
その他有価証券評価差額金	310,488	516,605
繰延税金負債合計	5,756,306	5,315,338
繰延税金資産(負債)の純額	2,963,538	2,566,958

(注) 評価性引当額が25,480千円増加しております。この増加の内容は、主としてその他有価証券評価差額金に係る評価性引当額を追加的に認識したことに伴うものであります。

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

	前事業年度 (2020年 3月 31日)	当事業年度 (2021年 3月 31日)
法定実効税率	30.6%	税引前当期純損失のため 記載を省略して おります。
(調整)		
評価性引当額の増減	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	7.3	
住民税均等割等	0.5	
所得税額控除による税額控除	0.5	
のれん償却費	44.1	
その他	3.3	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	68.4	

## (セグメント情報等)

前事業年度(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。

当事業年度(自 2020年4月1日 至2021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	50,610,457	9,450,169	1,270,584	233,628	61,564,839

### (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 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	㈱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㈱	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)

当事業年度(自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	事業の 内容又 は職業	議決権等の 所有(被所 有)割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社 の 子会社	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	3,728,851	未払 手数料	863,159
親会社 の 子会社	SMBC日興 証券㈱	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	5,578,226	未払 手数料	1,070,559

(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 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	3,369.33円	2,510.93円
1株当たり当期純利益又は 1株当たり当期純損失( )	17.09円	854.27円

(注) 1. 前事業年度の潜在株式調整後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。

当事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、1株当たり当期純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり当期純利益又は1株当たり当期純損失の算定上の基礎は、次のとおりであります。

	前事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
1株当たり当期純利益又は当期純損失		
当期純利益又は当期純損失( ) (千円)	578,811	28,934,237
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又は 当期純損失( ) (千円)	578,811	28,934,237
期中平均株式数(株)	33,870,060	33,870,060

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第37期中間会計期間 (2021年9月30日)	
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
現金及び預金	38,529,337
顧客分別金信託	300,038
前払費用	518,490
未収委託者報酬	10,909,133
未収運用受託報酬	2,723,571
未収投資助言報酬	399,072
未収収益	39,947
その他	224,189
流動資産合計	53,643,782
<b>固定資産</b>	
有形固定資産	1 2,218,463
無形固定資産	
のれん	3,502,221
顧客関連資産	14,615,253
その他	2,778,211
無形固定資産合計	20,895,685
投資その他の資産	
投資有価証券	22,000,657
関係会社株式	11,246,398
その他	1,595,579
貸倒引当金	20,750
投資その他の資産合計	34,821,886
固定資産合計	57,936,035
資産合計	111,579,818
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
リース債務	3,567
顧客からの預り金	12,736
その他の預り金	100,610
未払金	5,104,509
未払費用	7,204,066
未払法人税等	1,493,440
前受収益	32,829
賞与引当金	1,725,017

その他	2	695,069
流動負債合計		16,371,848
固定負債		
リース債務		6,309
繰延税金負債		2,389,323
退職給付引当金		5,414,560
その他		40,950
固定負債合計		7,851,143
負債合計		24,222,992
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
その他資本剰余金		73,466,962
資本剰余金合計		82,095,946
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		1,761,706
利益剰余金合計		2,045,951
株主資本合計		86,141,897
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		1,214,928
評価・換算差額等合計		1,214,928
純資産合計		87,356,826
負債純資産合計		111,579,818

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		32,740,035
運用受託報酬		4,392,826
投資助言報酬		633,982
その他の営業収益		117,708
営業収益計		37,884,552
営業費用		25,219,811
一般管理費	1	9,605,282
営業利益		3,059,458
営業外収益	2	198,028
営業外費用	3	26,126
経常利益		3,231,360
特別損失	4	146,753
税引前中間純利益		3,084,607
法人税、住民税及び事業税		1,373,478
法人税等調整額		334,822
法人税等合計		1,038,655
中間純利益		2,045,951

## (3)中間株主資本等変動計算書

第37期中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		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	81,927,000	90,555,984	284,245	60,000	1,476,959	10,281,242
当中間期変動額								
欠損填補			8,460,037	8,460,037				8,460,037
中間純利益								2,045,951
任意積立金の取崩						60,000	1,476,959	1,536,959
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）								
当中間期変動額合計	-	-	8,460,037	8,460,037	-	60,000	1,476,959	12,042,949
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	-	-	1,761,706

	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	8,460,037	84,095,946	949,365	949,365	85,045,311
当中間期変動額					
欠損填補	8,460,037	-			-
中間純利益	2,045,951	2,045,951			2,045,951
任意積立金の取崩					
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）			265,562	265,562	265,562
当中間期変動額合計	10,505,989	2,045,951	265,562	265,562	2,311,514
当中間期末残高	2,045,951	86,141,897	1,214,928	1,214,928	87,356,826

## 注記事項

## （重要な会計方針）

## 1．資産の評価基準及び評価方法

## (1)有価証券

## 子会社株式

移動平均法による原価法

## その他有価証券

市場価格のない株式等以外

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

市場価格のない株式等

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、主な耐用年数は次のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	4～15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中間会計期間の負担額を計上しております。

(3)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、当中間会計期間において発生していると認められる額を計上しております。

退職給付見込額の期間帰属方法

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

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. 収益及び費用の計上基準

「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 2020年3月31日。以下、「収益認識会計基準」という。)等を適用しており、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主な履行義務の内容及び収益を認識する通常の時点は以下のとおりであります。

(1)委託者報酬

委託者報酬は、投資信託の信託約款に基づき日々の純資産額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2)運用受託報酬

運用受託報酬は、対象顧客との投資一任契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の運用期間にわたり収益として認識しております。

(3)投資助言報酬

投資助言報酬は、対象顧客との投資助言契約に基づき、主に契約期間内の月末純資産平均価額に対する一定割合として認識され、確定した報酬を受け取ります。当該報酬は対象口座の助言期間にわたり収益として認識しております。

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(会計方針の変更)

「収益認識会計基準」等を当中間会計期間の期首から適用し、約束したサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該サービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。

当該会計基準等の適用が中間財務諸表に及ぼす影響はありません。

## (中間貸借対照表関係)

第37期中間会計期間 (2021年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,320,556千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui DS Asset Management(USA) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、2023年6月までの賃借料総額73,437千円の支払保証を行っております。	

## (中間損益計算書関係)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1.一般管理費のうち主要なもの	
のれん償却費	152,270千円
減価償却実施額	
有形固定資産	191,604千円
無形固定資産	1,304,363千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
為替差益	6,622千円
受取配当金	4,755千円
投資有価証券償還益	90,952千円
投資有価証券売却益	48,142千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	15,001千円
投資有価証券売却損	8,258千円
4.特別損失のうち主要なもの	
システム統合関連費用	145,261千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

## 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	33,870,060株	-	-	33,870,060株

## (リース取引関係)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1.オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	1,179,776千円
1年超	2,903,862千円
合計	4,083,639千円

## (金融商品関係)

## 1.金融商品の時価等に関する事項

第37期中間会計期間(2021年9月30日)

2021年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のないものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。



区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	38,529,337	38,529,337	-
(2)顧客分別金信託	300,038	300,038	-
(3)未収委託者報酬	10,909,133	10,909,133	-
(4)未収運用受託報酬	2,723,571	2,723,571	-
(5)未収投資助言報酬	399,072	399,072	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	21,960,848	21,960,848	-
(7)投資その他の資産 長期差入保証金	1,408,170	1,408,170	-
資産計	76,230,173	76,230,173	-
(1)顧客からの預り金	12,736	12,736	-
(2)未払金 未払手数料	4,996,181	4,996,181	-
負債計	5,008,917	5,008,917	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### 資産

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

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

(6)投資有価証券

    その他有価証券

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

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

(7)投資その他の資産

    長期差入保証金

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

#### 負債

(1)顧客からの預り金、及び(2)未払金 未払手数料

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

(注2)市場価格のない金融商品

(単位:千円)

区分	中間貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式	39,809
合計	39,809
子会社株式 非上場株式	11,246,398
合計	11,246,398

その他有価証券については、市場価格がないため、「(6) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がないため、時価開示の対象とはしておりません。

また時価をもって中間貸借対照表計上額としている「(6) その他有価証券」は、全て投資信託で構成されております。そのため、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」第26項の経過措置を適用し、金融商品の時価等及び時価のレベルごとの内訳等に関する事項は記載しておりません。

(有価証券関係)

第37期中間会計期間(2021年9月30日)

1.子会社株式

子会社株式(中間貸借対照表計上額 11,246,398千円)は、市場価格がないことから、記載しておりません。

2.その他有価証券

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	16,269,607	14,102,355	2,167,252
小計	16,269,607	14,102,355	2,167,252
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	5,691,240	6,001,639	310,398
小計	5,691,240	6,001,639	310,398
合計	21,960,848	20,103,994	1,856,853

(注)非上場株式等(中間貸借対照表計上額 39,809千円)については、市場価格がないことから、記載しておりません。

#### (デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

#### (収益認識関係)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

顧客との契約から生じる収益を分解した情報は、「セグメント情報等」注記に記載のとおりであります。

#### (セグメント情報等)

第37期中間会計期間(自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)

##### 1. セグメント情報

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

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

##### 2. 関連情報

###### (1)製品及びサービスごとの情報

(単位:千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	32,740,035	4,392,826	633,982	117,708	37,884,552

###### (2)地域ごとの情報

###### 営業収益

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

###### 有形固定資産

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

###### (3)主要な顧客ごとの情報

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

##### 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

##### 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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

##### 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

#### (1株当たり情報)

第37期中間会計期間 (自 2021年4月1日 至 2021年9月30日)	
1株当たり純資産額	2,579円18銭
1株当たり中間純利益	60円41銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
  - (イ) 定款の変更  
該当ありません。
  - (ロ) その他の重要事項  
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(2019年4月1日付)に伴って発生したのれんについて、2021年3月期決算において28,097,346千円の減損損失を計上しました。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実  
該当ありません。

#### 第2【その他の関係法人の概況】

##### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

- イ 受託会社
  - (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
  - (ロ) 資本金の額 342,037百万円(2021年3月末現在)

- (八) 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(2021年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
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D C証券株式会社	3,000百万円	
野村証券株式会社	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、2021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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2021年 2月25日	有価証券届出書
2021年 2月25日	有価証券報告書
2021年 8月26日	有価証券届出書
2021年 8月26日	半期報告書

**独立監査人の監査報告書**

2021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2020年4月1日から2021年3月31日までの第36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2021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、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**

2022年1月11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 菅野 雅子指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 松井 貴志**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、「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2020年12月1日から2021年11月30日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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2021年11月30日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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、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。

**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、ファンド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、経営者に対して、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

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 . 上記の監査報告書の原本は当社(有価証券報告書提出会社)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。



**独立監査人の中間監査報告書**

2021年11月22日

三井住友DSアセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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 明指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 菅 野 雅 子指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 佐 藤 栄 裕**中間監査意見**

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2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友DSアセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2021年4月1日から2021年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**中間監査意見の根拠**

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間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中間財務諸表の作成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。

**中間財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。
- ・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中間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、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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 . 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2 . X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。