

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2022年3月7日提出
【計算期間】	第18期中(自 2021年6月11日至 2021年12月10日)
【ファンド名】	大和住銀日本小型株ファンド
【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。

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

大和住銀日本小型株ファンド

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 (%)
株式	日本	7,518,972,200	94.75
現金・預金・その他の資産(負債控除後)	-	416,846,255	5.25
合計(純資産総額)		7,935,818,455	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)【運用実績】

【純資産の推移】

大和住銀日本小型株ファンド

年月日	純資産総額 (円)		1万口当たりの 純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第8期 (2012年 6月11日)	3,864,194,720	3,864,194,720	7,062	7,062
第9期 (2013年 6月10日)	5,686,141,117	6,270,865,198	10,697	11,797
第10期 (2014年 6月10日)	6,014,321,165	6,654,218,139	12,219	13,519
第11期 (2015年 6月10日)	7,336,054,409	8,114,580,707	15,077	16,677
第12期 (2016年 6月10日)	8,083,032,889	8,925,646,426	13,430	14,830
第13期 (2017年 6月12日)	11,891,549,723	13,183,957,102	17,482	19,382
第14期 (2018年 6月11日)	11,956,056,166	12,678,890,871	21,503	22,803
第15期 (2019年 6月10日)	9,135,449,986	9,135,449,986	16,540	16,540
第16期 (2020年 6月10日)	7,385,237,085	7,385,237,085	16,893	16,893
第17期 (2021年 6月10日)	6,851,455,559	7,149,056,430	19,569	20,419
2020年12月末日	7,078,013,005	-	18,447	-
2021年 1月末日	7,029,806,325	-	18,624	-
2月末日	7,073,920,883	-	19,131	-
3月末日	7,350,948,277	-	20,358	-
4月末日	7,154,503,685	-	20,078	-
5月末日	7,099,913,410	-	20,198	-
6月末日	6,916,363,696	-	19,405	-
7月末日	6,881,196,090	-	19,574	-
8月末日	6,961,936,353	-	20,007	-
9月末日	8,408,382,807	-	20,832	-
10月末日	8,235,788,122	-	20,522	-
11月末日	7,766,912,010	-	19,872	-

12月末日	7,935,818,455	-	20,476	-
-------	---------------	---	--------	---

【分配の推移】

大和住銀日本小型株ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第8期	2011年 6月11日～2012年 6月11日	0
第9期	2012年 6月12日～2013年 6月10日	1,100
第10期	2013年 6月11日～2014年 6月10日	1,300
第11期	2014年 6月11日～2015年 6月10日	1,600
第12期	2015年 6月11日～2016年 6月10日	1,400
第13期	2016年 6月11日～2017年 6月12日	1,900
第14期	2017年 6月13日～2018年 6月11日	1,300
第15期	2018年 6月12日～2019年 6月10日	0
第16期	2019年 6月11日～2020年 6月10日	0
第17期	2020年 6月11日～2021年 6月10日	850

【収益率の推移】

大和住銀日本小型株ファンド

	収益率(%)
第8期	17.1
第9期	67.0
第10期	26.4
第11期	36.5
第12期	1.6
第13期	44.3
第14期	30.4
第15期	23.1
第16期	2.1
第17期	20.9
第18期(中間期)	4.2

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

2【設定及び解約の実績】

大和住銀日本小型株ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第8期	195,983,563	1,783,693,777
第9期	1,503,387,242	1,659,766,285
第10期	1,168,063,988	1,561,453,035
第11期	1,243,659,757	1,300,154,810
第12期	2,055,037,825	902,159,067
第13期	4,121,355,076	3,337,879,099
第14期	181,294,444	1,423,171,578
第15期	959,106,628	996,255,870
第16期	696,826,261	1,848,157,387
第17期	147,325,957	1,017,925,837
第18期(中間期)	795,074,886	400,030,751

(注)本邦外における設定および解約の実績はありません。

3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第18期中間計算期間(2021年6月11日から2021年12月10日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【大和住銀日本小型株ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第17期 (2021年 6月10日現在)	第18期中間計算期間 (2021年12月10日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	11,172,425
コール・ローン	396,609,960	392,627,794
株式	6,721,645,200	7,586,893,000
未収入金	24,064,468	4,345,172
未収配当金	75,031,200	18,966,100
流動資産合計	7,217,350,828	8,014,004,491
資産合計		
	7,217,350,828	8,014,004,491
負債の部		
流動負債		
未払金	-	1,100,246
未払収益分配金	297,600,871	-
未払解約金	7,931,129	2,711,918
未払受託者報酬	3,140,198	3,320,331
未払委託者報酬	56,524,242	59,766,870
その他未払費用	698,829	376,116
流動負債合計	365,895,269	67,275,481
負債合計		
	365,895,269	67,275,481
純資産の部		
元本等		
元本	3,501,186,721	3,896,230,856
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	3,350,268,838	4,050,498,154
(分配準備積立金)	1,727,157,599	1,555,345,019
元本等合計	6,851,455,559	7,946,729,010
純資産合計		
	6,851,455,559	7,946,729,010
負債純資産合計		
	7,217,350,828	8,014,004,491

(2) 【中間損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第17期中間計算期間 自 2020年 6月11日 至 2020年12月10日	第18期中間計算期間 自 2021年 6月11日 至 2021年12月10日
営業収益		
受取配当金	42,562,300	60,378,744
受取利息	5,681	3,353
有価証券売買等損益	552,394,204	271,111,821
その他収益	7,297	4,998
営業収益合計	594,969,482	331,498,916
営業費用		
支払利息	102,868	133,405
受託者報酬	3,073,045	3,320,331
委託者報酬	55,315,653	59,766,870
その他費用	345,972	380,498
営業費用合計	58,837,538	63,601,104
営業利益又は営業損失 ()	536,131,944	267,897,812
経常利益又は経常損失 ()	536,131,944	267,897,812
中間純利益又は中間純損失 ()	536,131,944	267,897,812
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 ()	530,024	25,628,551
期首剰余金又は期首欠損金 ()	3,013,450,484	3,350,268,838
剰余金増加額又は欠損金減少額	87,150,218	845,939,339
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	87,150,218	845,939,339
剰余金減少額又は欠損金増加額	427,069,662	387,979,284
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	427,069,662	387,979,284
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 ()	3,210,193,008	4,050,498,154

(3)【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項目	第18期中間計算期間 自 2021年6月11日 至 2021年12月10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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

項目	第17期 (2021年6月10日現在)	第18期中間計算期間 (2021年12月10日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	3,501,186,721口	3,896,230,856口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9569円 (1万口当たりの純資産額19,569円)	1口当たり純資産額 2.0396円 (1万口当たりの純資産額20,396円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第18期中間計算期間 (2021年12月10日現在)
1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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>

(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等

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

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第17期 (2021年6月10日現在)	第18期中間計算期間 (2021年12月10日現在)
期首元本額	4,371,786,601円	3,501,186,721円
期中追加設定元本額	147,325,957円	795,074,886円
期中一部解約元本額	1,017,925,837円	400,030,751円

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

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

最近5年間における資本金の額の増減
該当ありません。

(2)【事業の内容及び営業の状況】

「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)【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。

5【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		
サービス支援手数料	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

当事業年度

(自 2019年4月1日 (自 2020年4月1日
至 2020年3月31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				

