

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年4月4日提出
【計算期間】	第22期中(自 2023年7月11日至 2024年1月10日)
【ファンド名】	大和住銀D C日本バリュー株ファンド
【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。

【分配の推移】

大和住銀DC日本バリュー株ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第12期	2013年 7月 9日～2014年 7月 8日	0
第13期	2014年 7月 9日～2015年 7月 8日	0
第14期	2015年 7月 9日～2016年 7月 8日	0
第15期	2016年 7月 9日～2017年 7月10日	0
第16期	2017年 7月11日～2018年 7月 9日	0
第17期	2018年 7月10日～2019年 7月 8日	0
第18期	2019年 7月 9日～2020年 7月 8日	0
第19期	2020年 7月 9日～2021年 7月 8日	0
第20期	2021年 7月 9日～2022年 7月 8日	0
第21期	2022年 7月 9日～2023年 7月10日	0

【収益率の推移】

大和住銀DC日本バリュー株ファンド

	収益率（％）
第12期	8.6
第13期	21.3
第14期	24.3
第15期	41.0
第16期	4.4
第17期	6.4
第18期	1.5
第19期	33.7
第20期	8.1
第21期	23.4
第22期（中間期）	13.0

（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。

（参考）

（1）投資状況

日本バリュー株マザーファンド

2024年1月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	日本	96,942,494,320	93.16
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	7,122,470,968	6.84
合計（純資産総額）		104,064,965,288	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	4,851,650,000	4.66
合計	買建	-	4,851,650,000	4.66

2【設定及び解約の実績】

大和住銀DC日本バリュー株ファンド

	設定口数(口)	解約口数(口)
第12期	5,530,852,724	5,177,054,831
第13期	4,936,046,532	5,355,156,643
第14期	4,224,377,000	3,426,330,535
第15期	3,496,647,555	4,032,979,388
第16期	4,080,900,693	3,709,093,413
第17期	2,794,864,919	3,466,315,140
第18期	3,092,885,489	3,722,202,488
第19期	2,879,741,103	3,164,174,873
第20期	3,843,842,141	3,100,361,249
第21期	4,180,431,634	3,233,082,298
第22期(中間期)	2,765,760,283	1,900,129,857

(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22期中間計算期間(2023年7月11日から2024年1月10日まで)の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【大和住銀DC日本バリュー株ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第21期 (2023年 7月10日現在)	第22期中間計算期間 (2024年 1月10日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	2,757,884	1,686,718
コール・ローン	99,651,092	98,845,408
親投資信託受益証券	59,782,778,757	70,973,154,533
未収入金	446,161,433	549,494,972
流動資産合計	60,331,349,166	71,623,181,631
資産合計	60,331,349,166	71,623,181,631
負債の部		
流動負債		
未払解約金	99,605,300	116,921,223
未払受託者報酬	23,330,641	28,885,942
未払委託者報酬	419,952,494	519,947,712
その他未払費用	2,125,321	1,155,050
流動負債合計	545,013,756	666,909,927
負債合計	545,013,756	666,909,927
純資産の部		
元本等		
元本	17,368,155,692	18,233,786,118
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金 ()	42,418,179,718	52,722,485,586
(分配準備積立金)	20,341,763,657	18,275,848,072
元本等合計	59,786,335,410	70,956,271,704
純資産合計	59,786,335,410	70,956,271,704
負債純資産合計	60,331,349,166	71,623,181,631

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	14,827,496,204円
同期中における追加設定元本額	2,544,807,813円
同期中における一部解約元本額	1,238,530,087円
2023年7月10日現在の元本の内訳	
三井住友D S日本バリュース株ファンド	3,639,028,126円
大和住銀D C日本バリュース株ファンド	12,485,699,705円
大和住銀日本バリュース株ファンドV A	9,046,099円
合計	16,133,773,930円

(2024年1月10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	16,133,773,930円
同期中における追加設定元本額	2,165,202,908円
同期中における一部解約元本額	513,012,109円
2024年1月10日現在の元本の内訳	
三井住友D S日本バリュース株ファンド	4,766,957,935円
大和住銀D C日本バリュース株ファンド	13,006,369,032円
大和住銀日本バリュース株ファンドV A	12,637,762円
合計	17,785,964,729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	2024年1月31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。

2024年1月31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	691	11,837,602
単位型株式投資信託	97	671,942
追加型公社債投資信託	1	25,398
単位型公社債投資信託	159	255,992
合計	948	12,790,935

(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

該当ありません。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実

該当ありません。

利益準備金	284,245
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	24,226,602
利益剰余金合計	24,510,847
株主資本合計	108,606,793
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	9,992
評価・換算差額等合計	9,992
純資産合計	108,616,786
負債純資産合計	133,470,988

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

		第39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		33,390,366
運用受託報酬		4,611,539
投資助言報酬		646,058
その他の営業収益		137,072
営業収益計		38,785,036
営業費用		26,393,207
一般管理費	1	10,162,729
営業利益		2,229,099
営業外収益	2	11,280,120
営業外費用	3	51,894
経常利益		13,457,325
特別利益	4	14,096,622
特別損失	5	358
税引前中間純利益		27,553,589
法人税、住民税及び事業税		5,843,255
法人税等調整額		716,591
法人税等合計		5,126,663
中間純利益		22,426,926

(3) 中間株主資本等変動計算書

第39期中間会計期間(自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金			利益剰余金	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	8,628,984	73,466,962	82,095,946	284,245	3,391,568
当中間期変動額						
剰余金の配当						1,591,892
中間純利益						22,426,926

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	33,390,366	4,611,539	646,058	137,072	38,785,036

(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39期中間会計期間 (自 2023年4月1日 至 2023年9月30日)	
1株当たり純資産額	3,206円86銭
1株当たり中間純利益	662円14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ありません。	

- ・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。

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. 上記の中間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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。

- ・ 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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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

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. 上記の中間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. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。