

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成29年2月23日提出
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土田 雅央
【電話番号】	03-5405-0740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	三井住友・日本株式インデックス年金ファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	継続募集額(平成29年2月24日から平成29年8月24日まで) 2兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

三井住友・日本株式インデックス年金ファンド  
以下「当ファンド」といいます。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

2兆5,000億円を上限とします。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「日株イン」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	電話番号	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="http://www.smam-jp.com">http://www.smam-jp.com</a>

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

### （５）【申込手数料】

無手数料です。

### （６）【申込単位】

お申込単位の詳細は、お申込みの販売会社または前記「(4)発行(売出)価格」に記載の委託会社にお問い合わせください。

(7)【申込期間】

平成29年 2月24日から平成29年 8月24日まで

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

(8)【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ わが国以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

ニ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

・ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理するもので、ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿(「振替口座簿」といいます。)への

記載・記録によって行われます。

- ・受益証券は発行されませんので、盗難や紛失のリスクが削減されます（原則として受益証券を保有することはできません。）。
- ・ファンドの設定、解約等における決済リスクが削減されます。
- ・振替口座簿に記録されますので、受益権の所在が明確になります。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と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）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(<http://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

## (2) 【ファンドの沿革】

平成15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。

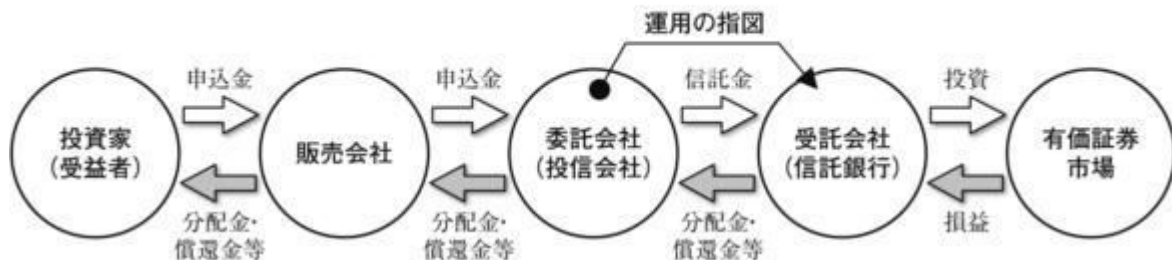
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社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

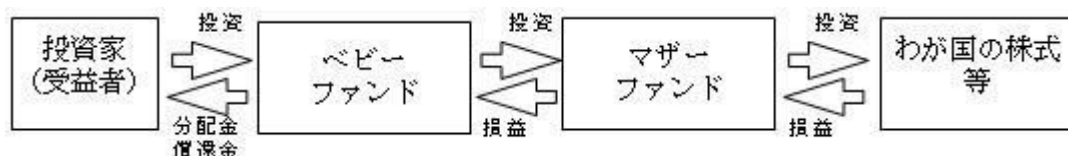
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

### 運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

「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。



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成28年12月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

昭和60年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

昭和62年2月20日 証券投資顧問業の登録

昭和62年6月10日	投資一任契約にかかる業務の認可
平成11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
平成11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
平成12年1月27日	証券投資信託委託業の認可取得
平成14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
平成25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

## (八) 大株主の状況

(平成28年12月30日現在)

名称	住所	所有 株式数	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	10,584	60.0
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	20.0
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	3,528	20.0

## 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、主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ロ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国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。
- (ニ) 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す。）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）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

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



### TOPIXとは

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

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

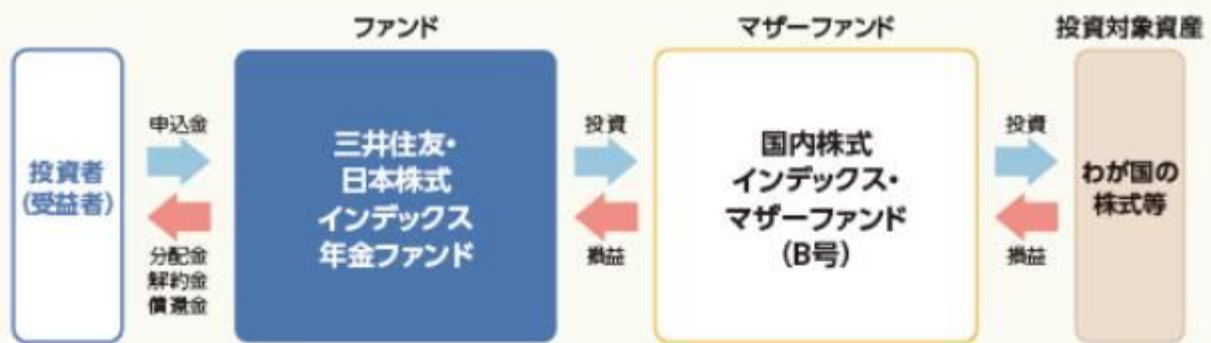
**2**

株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。

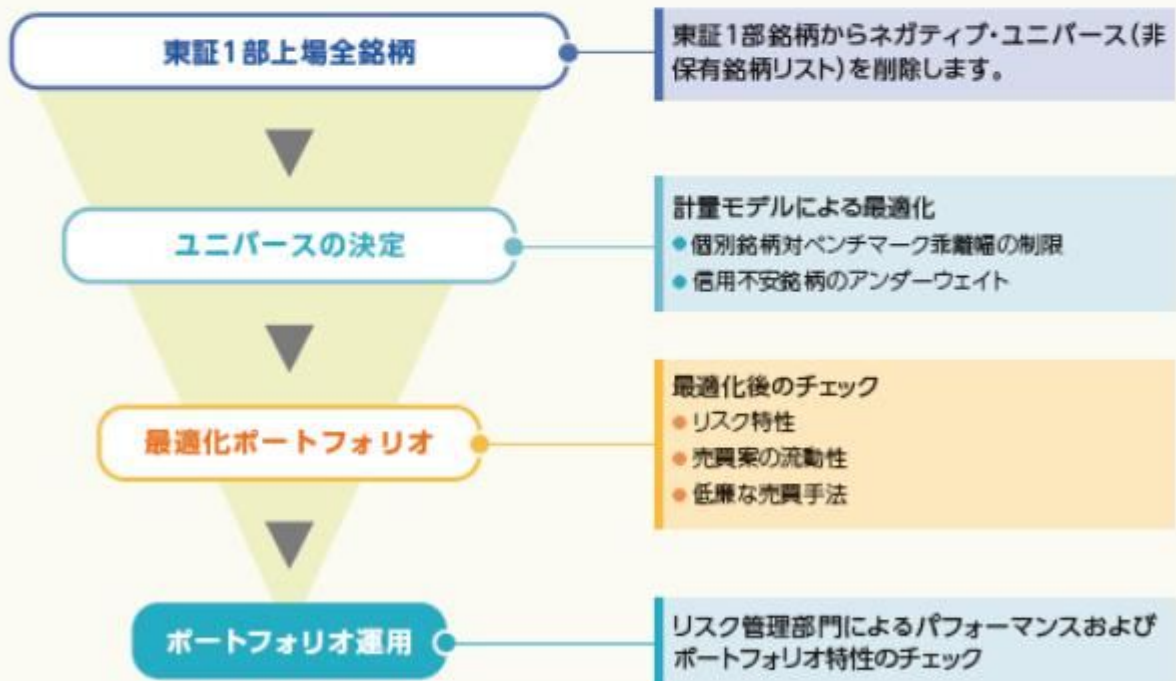
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## ファンドのしくみ

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



## 運用プロセス



### 最適化(法)とは

計量モデル等に基づいて、インデックスとの連動性を保てるように一部の銘柄を抽出してポートフォリオを構築する方法です。信用不安が懸念される銘柄を排除することや少額でもポートフォリオを構築することができるメリットがあります。

## ベンチマークの推移

- ・以下のグラフは、ファンドのベンチマーク(TOPIX(東証株価指数、配当込み))の推移です。
- ・ファンドの値動きのイメージをつかんでいただくため、ベンチマークの推移と国内外の主要な出来事を含わせて記載したものであり、ファンドの運用実績ではありません。
- ・ファンドの実際の運用実績は、後掲「基準価額・純資産の推移」をご覧ください。
- ・ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。



※データは1996年12月末～2016年12月末、1996年12月末を100として指数化。

※有価証券売買時のコストや信託報酬等の費用負担、組入有価証券の売買のタイミング差等の影響から、当ファンドの値動きは上記推移とは異なります。

※ベンチマーク(TOPIX(東証株価指数、配当込み))の著作権、知的所有権、その他一切の権利は発行者、許諾者が有しています。これら発行者、許諾者は当ファンドの運営に何ら関与するものではなく、当ファンドの運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

## (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。

## ハ 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記ロ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 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

#### （イ）計画（Plan）

国内外のエコノミスト、アナリスト、ファンドマネージャーが、マクロ経済環境、市場環境に関する分析・検討を行います。

これを元に、担当運用グループは投資政策委員会にて、運用方針を決定し月次運用計画を策定します。

#### （ロ）実行（Do）

担当運用グループは、月次運用計画に基づき、ファンドのポートフォリオの構築、およびポートフォリオ管理の一環として日々のリスクモニタリングを行います。

売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

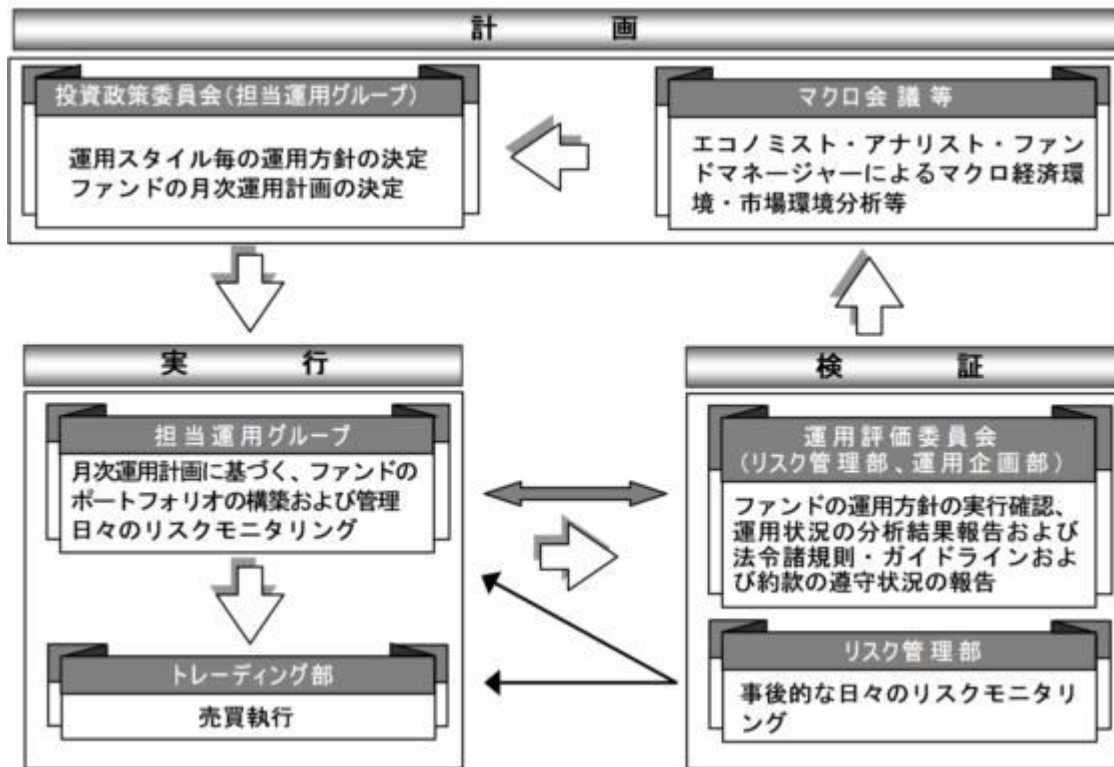
#### （ハ）検証（Check）

運用部門から組織的に分離されたリスク管理部が、約款の遵守状況等、ファンドの運営状況を日々モニタリングし、抵触があった場合直ちに担当運用グループへ状況確認がなされます。担当運用グループは対応結果をリスク管理部へ報告します。

運用評価委員会では、ファンドの運用方針の実行状況、運用状況の分析結果を確認します。また、運用の分析、評価結果、運用リスク状況、法令諸規則、運用ガイドライン、約款の遵守状況についても報告されます。

## 【ファンドの運用体制】





リスク管理部は12名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

ファンドの運用体制は、委託会社の組織変更等により、変更されることがあります。

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【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。
- ハ 収益の分配に充てず信託財産内に留保した利益については、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

ファンドは複利効果による信託財産の成長を優先するため、分配を極力抑制します。

（基準価額水準、市況動向等によっては変更する場合があります。）

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 外貨建資産への投資は行いません。
- 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。）。

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、わが国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、わが国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。

#### ハ 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。

#### ニ 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。
- (二) 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を乗じて得た数を越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。

□ 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越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。

（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

主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

□ 投資態度

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

（ロ）信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、わが国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。

（ニ）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。

□ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針（2）投資対象 □ 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。

### 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、主にわが国の株式を投資対象としています（マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。）。当ファンドの基準価額は、組み入れた株式の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化等の影響により上下します。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。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

当ファンドが有するリスク等（当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドへの投資を通じて間接的に受ける実質的なリスク等を含みます。）のうち主要なものは、以下の通りです。

#### （イ）株式市場リスク

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

#### （ロ）信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

#### （ハ）市場流動性リスク

ファンドの資金流出入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### （ニ）指数と連動しない要因

当ファンドは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）に連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、有価証券売買時のコストおよび信託報酬その他のファンド運営にかかる費用、追加設定・解約に伴う組入有価証券の売買のタイミング差、インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差の影響等から、上記インデックスに連動しないことがあります。

#### （ホ）ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

#### （ヘ）換金制限等に関する留意点

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

#### （ト）収益分配金に関する留意事項

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





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

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

#### □ 投資リスクの管理体制

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（リスク管理部および法務コンプライアンス部）を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる確認等を行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・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を行います。また、法務コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についての確認等を行います。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、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

#### （参考情報）投資リスクの定量的比較

## ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

各月末におけるファンドの1年間の騰落率と分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。



※年間騰落率、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。

## ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較

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



※ファンドの騰落率は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

日本株	TOPIX(配当込み) 株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	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	シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース) Citigroup Index LLCが開発した指数で、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】

無手数料です。

## (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0.27%（税抜き0.25%）の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。

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 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

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%	ファンド運用の指図等の対価
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

上記の各支払先の料率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24,840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）にあつた

ります。

- (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、各販売会社毎に個別元本の算出が行われず。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
- (ハ) 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

#### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

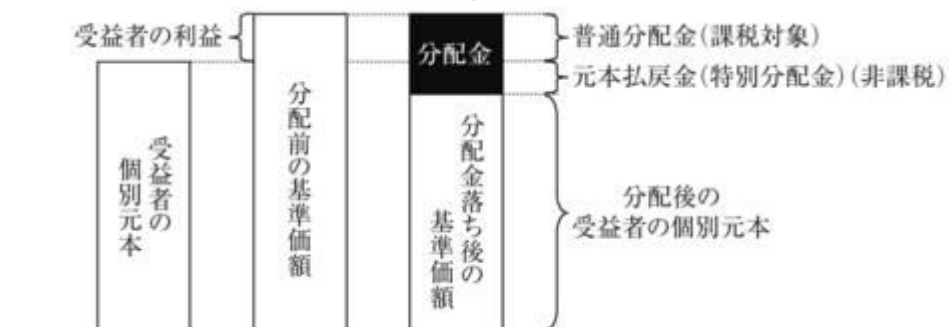
#### ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（所得税15.315%および

地方税5%)の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

・一部解約時および償還時

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

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

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAでの取扱い対象としない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

なお、当ファンドは、配当控除の適用が可能です。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で、新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。NISA、ジュニアNISAのご利用には、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。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への投資は行いません。

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す。）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。

上記にかかわらず、確定拠出年金制度における受益者が支払いを受ける収益分配金、一部解約金、償還金はいずれも課税されません。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成28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

平成28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	22,360,838,210	100.02

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,032,753	0.02
合計(純資産総額)		22,355,805,457	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

平成28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)	9,884,554,067	2.1866	21,613,565,923	2.2622	22,360,838,210	100.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### ロ 種類別の投資比率

平成28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5期 (平成19年11月30日)	8,246,779,721	8,246,779,721	18,924	18,924
第6期 (平成20年12月 1日)	5,672,518,090	5,672,518,090	10,398	10,398
第7期 (平成21年11月30日)	6,958,904,410	6,958,904,410	10,720	10,720
第8期 (平成22年11月30日)	8,594,601,878	8,594,601,878	11,172	11,172
第9期 (平成23年11月30日)	8,322,277,845	8,322,277,845	9,656	9,656
第10期 (平成24年11月30日)	9,844,615,684	9,844,615,684	10,577	10,577
第11期 (平成25年12月 2日)	16,669,083,903	16,669,083,903	17,321	17,321
第12期 (平成26年12月 1日)	19,103,300,879	19,103,300,879	19,898	19,898
第13期 (平成27年11月30日)	21,767,535,950	21,767,535,950	22,472	22,472
第14期 (平成28年11月30日)	22,218,652,970	22,218,652,970	21,289	21,289
平成27年12月末日	21,535,891,343		22,021	
平成28年 1月末日	20,359,746,987		20,376	
2月末日	18,548,290,038		18,461	
3月末日	19,682,136,034		19,346	
4月末日	19,361,359,608		19,242	
5月末日	20,086,006,898		19,812	
6月末日	18,622,228,281		17,910	
7月末日	19,786,862,269		19,015	
8月末日	20,029,438,332		19,114	
9月末日	20,152,534,840		19,170	
10月末日	21,259,357,056		20,183	
11月末日	22,218,652,970		21,289	
12月末日	22,355,805,457		22,023	

## 【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5期	平成18年12月 1日～平成19年11月30日	0
第6期	平成19年12月 1日～平成20年12月 1日	0
第7期	平成20年12月 2日～平成21年11月30日	0
第8期	平成21年12月 1日～平成22年11月30日	0
第9期	平成22年12月 1日～平成23年11月30日	0
第10期	平成23年12月 1日～平成24年11月30日	0
第11期	平成24年12月 1日～平成25年12月 2日	0
第12期	平成25年12月 3日～平成26年12月 1日	0
第13期	平成26年12月 2日～平成27年11月30日	0
第14期	平成27年12月 1日～平成28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5期	3.3
第6期	45.1
第7期	3.1
第8期	4.2
第9期	13.6
第10期	9.5
第11期	63.8
第12期	14.9
第13期	12.9
第14期	5.3

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

## （４）【設定及び解約の実績】

## 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第5期	2,004,114,058	1,723,929,063
第6期	2,007,005,825	909,624,540
第7期	1,808,043,090	771,644,827
第8期	1,899,478,919	698,410,230
第9期	1,980,301,744	1,054,324,453
第10期	1,867,808,738	1,178,961,753
第11期	3,617,090,901	3,300,844,517
第12期	2,724,295,913	2,747,487,141
第13期	3,852,586,112	3,766,659,896
第14期	3,454,541,463	2,704,530,895

（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）



平成28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	201,590,407,820	98.33
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,422,463,158	1.67
合計(純資産総額)		205,012,870,978	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	3,218,160,000	1.56
合計	買建	-	3,218,160,000	1.56

## (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)

平成28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	1,106,600	6,649.00	7,357,783,400	6,878.00	7,611,194,800	3.71
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	6,808,000	669.80	4,559,998,400	720.20	4,903,121,600	2.39
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	720,900	4,625.00	3,334,162,500	4,912.00	3,541,060,800	1.73
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	719,200	4,206.00	3,024,955,200	4,460.00	3,207,632,000	1.56
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	404,400	6,712.00	2,714,332,800	7,765.00	3,140,166,000	1.53
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	818,500	3,332.00	2,727,242,000	3,415.00	2,795,177,500	1.36
日本	株式	KDDI	情報・通信業	888,400	2,999.00	2,664,311,600	2,959.50	2,629,219,800	1.28
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	12,193,700	202.60	2,470,443,620	209.80	2,558,238,260	1.25
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	564,900	3,946.00	2,229,095,400	3,844.00	2,171,475,600	1.06
日本	株式	ソニー	電気機器	642,500	3,288.00	2,112,540,000	3,275.00	2,104,187,500	1.03
日本	株式	ファナック	電気機器	92,200	19,305.00	1,779,921,000	19,815.00	1,826,943,000	0.89
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	670,800	2,624.00	1,760,179,200	2,663.00	1,786,340,400	0.87

日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	175,900	9,766.00	1,717,839,400	10,100.00	1,776,590,000	0.87
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	363,400	4,899.00	1,780,296,600	4,796.00	1,742,866,400	0.85
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	356,900	4,685.00	1,672,076,500	4,835.00	1,725,611,500	0.84
日本	株式	三菱商事	卸売業	674,000	2,471.50	1,665,791,000	2,490.00	1,678,260,000	0.82
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	375,500	4,435.00	1,665,342,500	4,453.00	1,672,101,500	0.82
日本	株式	キーエンス	電気機器	20,600	78,230.00	1,611,538,000	80,200.00	1,652,120,000	0.81
日本	株式	キヤノン	電気機器	490,000	3,261.00	1,597,890,000	3,295.00	1,614,550,000	0.79
日本	株式	三菱電機	電気機器	970,200	1,576.50	1,529,520,300	1,629.50	1,580,940,900	0.77
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	973,000	1,579.50	1,536,853,500	1,623.50	1,579,665,500	0.77
日本	株式	三菱地所	不動産業	668,000	2,305.50	1,540,074,000	2,327.50	1,554,770,000	0.76
日本	株式	信越化学工業	化学	170,800	8,460.00	1,444,968,000	9,067.00	1,548,643,600	0.76
日本	株式	村田製作所	電気機器	95,400	15,425.00	1,471,545,000	15,650.00	1,493,010,000	0.73
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	75,600	18,680.00	1,412,208,000	19,230.00	1,453,788,000	0.71
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,183,000	609.30	1,330,101,900	632.00	1,379,656,000	0.67
日本	株式	任天堂	その他製品	56,100	27,775.00	1,558,177,500	24,540.00	1,376,694,000	0.67
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	321,300	4,367.00	1,403,117,100	4,214.00	1,353,958,200	0.66
日本	株式	富士重工	輸送用機器	282,800	4,645.00	1,313,606,000	4,772.00	1,349,521,600	0.66
日本	株式	花王	化学	242,100	5,267.00	1,275,140,700	5,541.00	1,341,476,100	0.65

□ 種類別・業種別の投資比率

平成28年12月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.35
		建設業	3.00
		食料品	4.40
		繊維製品	0.69
		パルプ・紙	0.23
		化学	6.39
		医薬品	4.70
		石油・石炭製品	0.51
		ゴム製品	0.90
		ガラス・土石製品	0.94
		鉄鋼	1.25
		非鉄金属	0.90
		金属製品	0.69
		機械	4.90
		電気機器	12.12
		輸送用機器	9.62
		精密機器	1.53
その他製品	1.77		

	電気・ガス業	1.87
	陸運業	4.25
	海運業	0.22
	空運業	0.53
	倉庫・運輸関連業	0.20
	情報・通信業	7.59
	卸売業	4.33
	小売業	4.69
	銀行業	8.38
	証券、商品先物取引業	1.20
	保険業	2.58
	その他金融業	1.29
	不動産業	2.59
	サービス業	3.61
合計		98.33

#### 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）

平成28年12月30日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	簿価 （円）	時価 （円）	投資 比率 （%）
株価指数先物 取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	212	日本円	3,261,358,640	3,218,160,000	1.56

（注）主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

#### 参考情報

基準日:2016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口当たり、信託報酬控除後です。

## 分配の推移

決算期	分配金
2016年11月	0円
2015年11月	0円
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012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。

## 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に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または委託会社にお問い合わせください。

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

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

#### ロ 申込価額

取得申込受付日の基準価額となります。

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

#### 八 申込手数料

無手数料です。

#### 二 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

#### ホ 照会先

申込単位の詳細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	電話番号	インターネット・ ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時までとさせていただきます。

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約請求（一部解約の実行請求）により換金することができます。

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

解約請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるファンドの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引換えに、当該解約請求にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定に従い当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

一部解約金は、解約請求受付日から起算して4営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の基準価額となります。

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社（電話：0120-88-2976）にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。

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

## 3【資産管理等の概要】

### （1）【資産の評価】

#### イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

□ 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	電話番号	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

お問い合わせは、原則として営業日の午前9時～午後5時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】

平成15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あるため、将来の分配金の支払およびその金額について保証するものではありません。
  - b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。
- ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

### (ロ) 償還金

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

## 八 信託約款の変更

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社

と合意の上、当ファンドの信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。

- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- (ハ) 上記(ロ)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、(イ)の信託約款の変更をしません。
- (ホ) 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

## 二 反対者の買取請求権

当ファンドの信託契約の解約または重大な信託約款の変更が行われる場合において、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間内に委託会社に異議を述べた受益者は、自己に帰属する受益権を、受託会社に信託財産をもって買い取るよう請求をすることができます。

## ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受け、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でも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

## ヘ 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、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て)に支払われます。ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引



いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金は、受益者が、その支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

#### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

#### ハ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

#### ニ 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に関する異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となるときは、当該解約または信託約款変更は行われません。

当該解約または信託約款変更が行われる場合において、前述の異議を申し立てた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

#### ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は委託会社に対し、当該受益者にかかる信託財産に関する書類の閲覧または謄写を請求することができます。

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期（平成27年12月1日から平成28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13期 (平成27年11月30日現在)	第14期 (平成28年11月30日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	-	69,091,143
コール・ローン	55,371,848	20,010,754
親投資信託受益証券	21,795,952,860	22,245,699,803
未収利息	15	-
<b>流動資産合計</b>	<b>21,851,324,723</b>	<b>22,334,801,700</b>
<b>資産合計</b>	<b>21,851,324,723</b>	<b>22,334,801,700</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	55,370,123	89,104,634
未払受託者報酬	4,545,066	4,324,792
未払委託者報酬	23,861,531	22,705,144
未払利息	-	58
その他未払費用	12,053	14,102
<b>流動負債合計</b>	<b>83,788,773</b>	<b>116,148,730</b>
<b>負債合計</b>	<b>83,788,773</b>	<b>116,148,730</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	9,686,492,837	10,436,503,405
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	12,081,043,113	11,782,149,565
<b>元本等合計</b>	<b>21,767,535,950</b>	<b>22,218,652,970</b>
<b>純資産合計</b>	<b>21,767,535,950</b>	<b>22,218,652,970</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>21,851,324,723</b>	<b>22,334,801,700</b>

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	平成26年12月 2日 至 平成27年11月30日	自	平成27年12月 1日 至 平成28年11月30日
営業収益				
受取利息		3,718		427
有価証券売買等損益		2,596,007,550		916,246,001
営業収益合計		2,596,011,268		916,245,574
営業費用				
支払利息		-		11,711
受託者報酬		8,916,556		8,558,716
委託者報酬		46,811,769		44,933,180
その他費用		24,065		29,685
営業費用合計		55,752,390		53,533,292
営業利益又は営業損失（ ）		2,540,258,878		969,778,866
経常利益又は経常損失（ ）		2,540,258,878		969,778,866
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,540,258,878		969,778,866
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（ ）		670,606,213		675,455,114
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		9,502,734,258		12,081,043,113
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,533,743,234		3,235,823,493
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,533,743,234		3,235,823,493
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,825,087,044		3,240,393,289
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,825,087,044		3,240,393,289
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（ ）		12,081,043,113		11,782,149,565

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第14期
	自 平成27年12月 1日 至 平成28年11月30日
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>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第13期	第14期
	( 平成27年11月30日現在 )	( 平成28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	9,686,492,837口	10,436,503,405口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2472円 (10,000口当たりの純資産額 22,472円)	1口当たり純資産額 2.1289円 (10,000口当たりの純資産額 21,289円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第13期	第14期
	自 平成26年12月 2日 至 平成27年11月30日	自 平成27年12月 1日 至 平成28年11月30日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（378,213,566円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,491,439,099円）、収益調整金（7,307,015,335円）、および分配準備積立金（3,388,738,796円）より、分配対象収益は12,565,406,796円（1万口当たり12,972.07円）であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（380,159,274円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（9,516,439,188円）、および分配準備積立金（4,030,731,317円）より、分配対象収益は13,927,329,779円（1万口当たり13,344.80円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項目	第14期
	自 平成27年12月 1日 至 平成28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>

項目	第14期 自 平成27年12月 1日 至 平成28年11月30日
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第14期 (平成28年11月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

第13期（自 平成26年12月 2日 至 平成27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	2,284,213,361円
合計	2,284,213,361円

第14期（自 平成27年12月 1日 至 平成28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	606,843,387円
合計	606,843,387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14期 自 平成27年12月 1日 至 平成28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13期 （平成27年11月30日現在）	第14期 （平成28年11月30日現在）
期首元本額	9,600,566,621円	9,686,492,837円
期中追加設定元本額	3,852,586,112円	3,454,541,463円
期中一部解約元本額	3,766,659,896円	2,704,530,895円

## （4）【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式



該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）	10,175,044,506	22,245,699,803	
合計		10,175,044,506	22,245,699,803	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

三井住友・日本株式インデックス年金ファンドは、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

貸借対照表

(単位：円)

	(平成27年11月30日現在)	(平成28年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	2,526,081,967
コール・ローン	1,437,728,443	731,624,938
株式	220,246,022,400	200,450,853,880
派生商品評価勘定	530,000	128,254,000
未収入金	2,660,189,984	-
未収配当金	1,224,249,670	1,207,087,166
未収利息	393	-
前払金	32,470,000	-
差入委託証拠金	-	22,650,000
流動資産合計	225,601,190,890	205,066,551,951
資産合計	225,601,190,890	205,066,551,951
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	33,000,000	-
前受金	-	128,335,000
未払金	27,842,560	-
未払解約金	821,116,734	239,375,544
未払利息	-	2,144
その他未払費用	-	68,042
流動負債合計	881,959,294	367,780,730
負債合計	881,959,294	367,780,730

（平成27年11月30日現在）

（平成28年11月30日現在）

純資産の部		
元本等		
元本	97,649,281,775	93,628,160,347
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	127,069,949,821	111,070,610,874
元本等合計	224,719,231,596	204,698,771,221
純資産合計	224,719,231,596	204,698,771,221
負債純資産合計	225,601,190,890	205,066,551,951

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成27年12月1日 至平成28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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成27年11月30日現在）	（平成28年11月30日現在）
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,828,500,000円</p>	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,324,500,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	97,649,281,775口	93,628,160,347口
3. 1単位当たり純資産の	1口当たり純資産額 2.3013円	1口当たり純資産額 2.1863円

額	(10,000口当たりの純資産額	23,013円)	(10,000口当たりの純資産額	21,863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 平成27年12月 1日 至 平成28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、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。当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、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、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、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、当該関連運用グループ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、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会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部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成28年11月30日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<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)

(平成27年11月30日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,319,690,000	-	4,287,220,000	32,470,000
	東証株価指数先物	4,319,690,000	-	4,287,220,000	32,470,000
合計		4,319,690,000	-	4,287,220,000	32,470,000

（平成28年11月30日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,146,346,000	-	4,274,600,000	128,254,000
	東証株価指数先物	4,146,346,000	-	4,274,600,000	128,254,000
合計		4,146,346,000	-	4,274,600,000	128,254,000

（注）1．時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成27年12月 1日 至 平成28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）

（平成27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	137,241,405,220円
同期中における追加設定元本額	12,106,899,858円
同期中における一部解約元本額	51,699,023,303円
平成27年11月30日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,471,147,986円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	449,817,995円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,333,879,001円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,712,272,952円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	96,951,463円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	7,312,741円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	16,089,296円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	54,889,113円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	39,254,344円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	23,299,297円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	52,828,272円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	2,047,871,559円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	819,024,554円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	160,054,821円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	334,120,175円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	446,050,758円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	15,740,424,562円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	135,156,700円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	16,738,816,612円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	7,070,082,968円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	3,744,949,551円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	13,909,541,681円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	81,139,729円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	319,250,671円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	23,169,987円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	1,523,347,290円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定>	78,999,123円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	542,788,810円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	1,672,830,912円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	2,737,697,057円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	4,914,897,747円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	122,119,741円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,459,071,975円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	99,843,434円
SMAM・バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	170,845,899円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,011,596,233円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	146,753,322円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	75,310,804円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	32,805,640円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	325,447,289円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	581,866,839円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	237,387,899円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	160,023,807円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	86,411,611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 >	12,700,551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 >	121,279,739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 >	1,412,663,798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 )	262,607,839円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	29,807,987円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	305,920円
S M A M ・ F G グローバルバランス2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	2,473,721円
合計	97,649,281,775円

(平成28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	97,649,281,775円
同期中における追加設定元本額	21,580,495,893円
同期中における一部解約元本額	25,601,617,321円
平成28年11月30日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,175,044,506円
三井住友・D C 年金バランス3 0 ( 債券重点型 )	566,683,968円
三井住友・D C 年金バランス5 0 ( 標準型 )	2,748,752,313円
三井住友・D C 年金バランス7 0 ( 株式重点型 )	1,966,264,683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 )	118,298,305円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 0	8,827,446円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 2 5	23,369,792円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 0	60,888,460円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 3 5	56,096,815円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 0	30,502,259円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2 0 4 5	74,957,122円
国内株式指数ファンド ( T O P I X )	2,127,403,424円
三井住友・D C 日本株式インデックスファンドS	1,391,011,637円
アセットアロケーション・ファンド ( 安定型 )	1,927,229,409円
アセットアロケーション・ファンド ( 安定成長型 )	1,980,111,432円
アセットアロケーション・ファンド ( 成長型 )	2,323,999,880円
イオン・バランス戦略ファンド	31,755,756円
三井住友・D C ターゲットイヤーファンド2 0 5 0	3,762,845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 )	14,630,089,299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 >	74,235,620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 >	10,921,926,986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 >	5,928,139,959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 >	3,506,753,841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 >	12,994,345,718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 >	72,262,813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 >	318,914,967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 >	14,442,621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 >	1,359,747,939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 >	79,014,405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 >	510,341,880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 >	1,556,018,951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 >	2,629,403,754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 >	4,574,012,622円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	118,317,004円
三井住友 ・ 5 資産バランスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	2,273,096,206円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	102,877,758円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	163,643,207円
三井住友 ・ 7 資産バランスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	2,540,651,763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 >	146,094,154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 >	67,167,084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 >	32,274,637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 >	317,606,290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 >	530,906,900円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	242,434,474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 >	158,652,472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 >	77,146,993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 >	12,767,533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 >	104,475,263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 >	1,386,827,064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 )	255,155,917円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	28,000,161円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	24,037円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	496,588円
S M A M ・ グローバル ・ マルチアセット ・ グロース ・ ファンド ( 安定成長型 ) < 適格機関投資家限定 >	786,297円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	265,875円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 4 < 適格機関投資家限定 >	134,448,755円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	64,432,247円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー ・ オープン < 適格機関投資家限定 >	85,000,241円
合計	93,628,160,347円

## 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	4,500	2,703.00	12,163,500	
日本水産	136,100	514.00	69,955,400	
マルハニチロ	19,900	2,910.00	57,909,000	
カネコ種苗	4,700	1,464.00	6,880,800	
サカタのタネ	15,100	2,994.00	45,209,400	



ホクト	10,300	2,009.00	20,692,700
日鉄鉱業	3,000	5,230.00	15,690,000
三井松島産業	7,400	1,324.00	9,797,600
国際石油開発帝石	551,300	1,085.00	598,160,500
日本海洋掘削	4,100	2,375.00	9,737,500
石油資源開発	17,000	2,327.00	39,559,000
K&Oエナジーグループ	7,100	1,701.00	12,077,100
ショーボンドホールディングス	10,600	5,130.00	54,378,000
ミライト・ホールディングス	32,000	1,095.00	35,040,000
タマホーム	12,200	548.00	6,685,600
ダイセキ環境ソリューション	3,500	1,498.00	5,243,000
安藤・間	74,600	803.00	59,903,800
東急建設	36,800	938.00	34,518,400
コムシスホールディングス	40,700	1,955.00	79,568,500
ミサワホーム	13,500	1,009.00	13,621,500
高松コンストラクショングループ	7,300	2,539.00	18,534,700
東建コーポレーション	4,200	7,920.00	33,264,000
大成建設	530,000	828.00	438,840,000
大林組	312,600	1,088.00	340,108,800
清水建設	319,000	1,054.00	336,226,000
飛鳥建設	103,600	194.00	20,098,400
長谷工コーポレーション	122,000	1,184.00	144,448,000
松井建設	12,600	1,104.00	13,910,400
銭高組	18,000	426.00	7,668,000
鹿島建設	459,000	802.00	368,118,000
不動テトラ	88,700	213.00	18,893,100
鉄建建設	64,000	351.00	22,464,000
西松建設	122,000	562.00	68,564,000
三井住友建設	401,900	127.00	51,041,300
大豊建設	38,000	574.00	21,812,000
前田建設工業	65,000	1,065.00	69,225,000
ナカノフドー建設	10,300	619.00	6,375,700
奥村組	86,000	666.00	57,276,000
東鉄工業	12,200	3,040.00	37,088,000
イチケン	11,000	434.00	4,774,000
浅沼組	37,000	341.00	12,617,000
戸田建設	121,000	641.00	77,561,000
熊谷組	163,000	294.00	47,922,000
青木あすなろ建設	8,700	730.00	6,351,000
北野建設	28,000	312.00	8,736,000
三井ホーム	17,000	466.00	7,922,000
矢作建設工業	14,800	990.00	14,652,000

日本ハウスホールディングス	25,800	415.00	10,707,000
大東建託	38,600	17,775.00	686,115,000
新日本建設	13,200	967.00	12,764,400
N I P P O	23,000	2,189.00	50,347,000
東亜道路工業	26,000	317.00	8,242,000
前田道路	33,000	1,968.00	64,944,000
日本道路	31,000	441.00	13,671,000
東亜建設工業	8,800	1,906.00	16,772,800
若築建設	73,000	163.00	11,899,000
東洋建設	33,800	413.00	13,959,400
五洋建設	117,400	561.00	65,861,400
大林道路	12,500	706.00	8,825,000
世紀東急工業	17,900	510.00	9,129,000
福田組	17,000	1,156.00	19,652,000
住友林業	72,000	1,565.00	112,680,000
日成ビルド工業	32,000	538.00	17,216,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	83,000	78.00	6,474,000
巴コーポレーション	20,200	354.00	7,150,800
パナホーム	38,000	812.00	30,856,000
大和ハウス工業	309,000	3,252.00	1,004,868,000
ライト工業	20,100	1,270.00	25,527,000
積水ハウス	329,400	1,870.00	615,978,000
日特建設	12,500	491.00	6,137,500
北陸電気工事	6,100	894.00	5,453,400
ユアテック	17,000	776.00	13,192,000
中電工	12,400	2,305.00	28,582,000
関電工	41,000	1,065.00	43,665,000
きんでん	69,400	1,443.00	100,144,200
東京エネシス	12,000	953.00	11,436,000
トーエネック	17,000	533.00	9,061,000
住友電設	8,100	1,221.00	9,890,100
日本電設工業	16,700	1,849.00	30,878,300
協和エクシオ	41,500	1,618.00	67,147,000
新日本空調	9,100	1,257.00	11,438,700
N D S	2,600	2,811.00	7,308,600
九電工	20,300	3,210.00	65,163,000
三機工業	23,200	959.00	22,248,800
日揮	97,700	1,888.00	184,457,600
中外炉工業	40,000	208.00	8,320,000
ヤマト	12,400	549.00	6,807,600
太平電業	15,000	1,109.00	16,635,000
高砂熱学工業	28,200	1,525.00	43,005,000

朝日工業社	3,000	2,962.00	8,886,000
明星工業	20,800	549.00	11,419,200
大気社	13,700	2,822.00	38,661,400
ダイダン	15,000	940.00	14,100,000
日比谷総合設備	11,500	1,642.00	18,883,000
東芝プラントシステム	16,900	1,714.00	28,966,600
O S J Bホールディングス	38,500	239.00	9,201,500
東洋エンジニアリング	63,000	320.00	20,160,000
千代田化工建設	76,000	821.00	62,396,000
新興プランテック	22,000	807.00	17,754,000
日本製粉	30,200	1,546.00	46,689,200
日清製粉グループ本社	114,100	1,603.00	182,902,300
日東富士製粉	1,400	3,785.00	5,299,000
昭和産業	42,000	588.00	24,696,000
鳥越製粉	11,900	798.00	9,496,200
中部飼料	12,400	1,034.00	12,821,600
フィード・ワン	77,600	152.00	11,795,200
日本甜菜製糖	6,200	2,225.00	13,795,000
三井製糖	7,300	2,375.00	17,337,500
日新製糖	5,300	1,601.00	8,485,300
森永製菓	20,500	4,525.00	92,762,500
中村屋	3,000	4,770.00	14,310,000
江崎グリコ	26,200	5,350.00	140,170,000
名糖産業	6,600	1,378.00	9,094,800
不二家	72,000	215.00	15,480,000
山崎製パン	76,800	2,269.00	174,259,200
モロゾフ	21,000	456.00	9,576,000
亀田製菓	5,800	5,250.00	30,450,000
寿スピリッツ	7,500	2,632.00	19,740,000
カルビー	42,800	3,565.00	152,582,000
森永乳業	95,000	784.00	74,480,000
六甲バター	4,900	2,532.00	12,406,800
ヤクルト本社	56,200	5,020.00	282,124,000
明治ホールディングス	61,800	9,120.00	563,616,000
雪印メグミルク	22,800	3,200.00	72,960,000
プリマハム	65,000	398.00	25,870,000
日本ハム	71,000	2,946.00	209,166,000
丸大食品	49,000	472.00	23,128,000
S Foods	5,500	2,703.00	14,866,500
伊藤ハム米久ホールディングス	57,500	998.00	57,385,000
サッポロホールディングス	34,400	3,010.00	103,544,000
アサヒグループホールディングス	196,500	3,722.00	731,373,000

キリンホールディングス	451,000	1,863.50	840,438,500
宝ホールディングス	76,200	1,041.00	79,324,200
オエノンホールディングス	36,000	257.00	9,252,000
養命酒製造	4,500	1,797.00	8,086,500
コカ・コーラウエスト	35,200	3,240.00	114,048,000
コカ・コーライーストジャパン	40,700	2,417.00	98,371,900
サントリー食品インターナショナル	71,500	4,895.00	349,992,500
ダイドードリンコ	4,700	5,650.00	26,555,000
伊藤園	31,200	3,780.00	117,936,000
キーコーヒー	8,800	2,088.00	18,374,400
日清オイリオグループ	59,000	487.00	28,733,000
不二製油グループ本社	28,300	2,158.00	61,071,400
J・オイルミルズ	4,800	3,730.00	17,904,000
キッコーマン	73,000	3,500.00	255,500,000
味の素	215,900	2,212.50	477,678,750
キューピー	53,500	2,703.00	144,610,500
ハウス食品グループ本社	38,600	2,294.00	88,548,400
カゴメ	37,800	2,687.00	101,568,600
焼津水産化学工業	7,100	1,011.00	7,178,100
アリアケジャパン	8,400	5,720.00	48,048,000
ニチレイ	51,500	2,315.00	119,222,500
東洋水産	51,300	4,050.00	207,765,000
日清食品ホールディングス	40,800	5,960.00	243,168,000
永谷園ホールディングス	11,000	1,340.00	14,740,000
一正蒲鉾	5,300	1,109.00	5,877,700
フジッコ	10,100	2,342.00	23,654,200
ロック・フィールド	10,900	1,438.00	15,674,200
日本たばこ産業	580,200	3,946.00	2,289,469,200
ケンコーマヨネーズ	4,000	3,220.00	12,880,000
わらべや日洋ホールディングス	6,300	2,404.00	15,145,200
なとり	6,500	1,741.00	11,316,500
ユーグレナ	33,700	1,284.00	43,270,800
ミヨシ油脂	51,000	141.00	7,191,000
理研ビタミン	3,200	4,435.00	14,192,000
片倉工業	13,300	1,279.00	17,010,700
ゲンゼ	72,000	378.00	27,216,000
東洋紡	395,000	172.00	67,940,000
ユニチカ	276,000	86.00	23,736,000
富士紡ホールディングス	5,100	3,565.00	18,181,500
倉敷紡績	100,000	231.00	23,100,000
シキボウ	71,000	139.00	9,869,000
日本毛織	27,900	800.00	22,320,000

帝国繊維	10,600	1,637.00	17,352,200
帝人	80,100	2,118.00	169,651,800
東レ	710,000	929.40	659,874,000
サカイオーベックス	3,700	1,775.00	6,567,500
住江織物	32,000	243.00	7,776,000
アツギ	102,000	121.00	12,342,000
ダイニック	35,000	169.00	5,915,000
セーレン	24,600	1,466.00	36,063,600
小松精練	16,600	669.00	11,105,400
ワコールホールディングス	59,000	1,327.00	78,293,000
ホギメディカル	6,200	6,720.00	41,664,000
レナウン	44,600	113.00	5,039,800
T S Iホールディングス	40,500	657.00	26,608,500
三陽商会	63,000	158.00	9,954,000
オンワードホールディングス	65,000	751.00	48,815,000
ルック	31,000	173.00	5,363,000
ゴールドウイン	4,300	4,960.00	21,328,000
デサント	22,600	1,253.00	28,317,800
特種東海製紙	5,600	3,995.00	22,372,000
王子ホールディングス	379,000	469.00	177,751,000
日本製紙	43,500	1,978.00	86,043,000
三菱製紙	16,200	750.00	12,150,000
北越紀州製紙	55,700	656.00	36,539,200
中越パルプ工業	43,000	240.00	10,320,000
巴川製紙所	19,000	254.00	4,826,000
大王製紙	38,100	1,258.00	47,929,800
レンゴー	95,100	677.00	64,382,700
トモク	35,000	320.00	11,200,000
ザ・パック	6,700	2,589.00	17,346,300
クラレ	163,800	1,618.00	265,028,400
旭化成	611,000	1,017.50	621,692,500
共和レザー	7,900	795.00	6,280,500
昭和電工	65,400	1,544.00	100,977,600
住友化学	718,000	523.00	375,514,000
住友精化	4,100	4,310.00	17,671,000
日産化学工業	53,400	3,805.00	203,187,000
ラサ工業	51,000	131.00	6,681,000
クレハ	7,400	4,670.00	34,558,000
テイカ	17,000	617.00	10,489,000
石原産業	18,300	958.00	17,531,400
日東エフシー	7,000	889.00	6,223,000
日本曹達	59,000	496.00	29,264,000

東ソー	283,000	768.00	217,344,000
トクヤマ	154,000	449.00	69,146,000
セントラル硝子	103,000	452.00	46,556,000
東亜合成	62,000	1,107.00	68,634,000
大阪ソーダ	42,000	470.00	19,740,000
関東電化工業	21,000	950.00	19,950,000
デンカ	203,000	505.00	102,515,000
信越化学工業	175,400	8,460.00	1,483,884,000
日本カーバイド工業	42,000	149.00	6,258,000
堺化学工業	36,000	358.00	12,888,000
エア・ウォーター	80,100	1,955.00	156,595,500
大陽日酸	75,200	1,252.00	94,150,400
日本化学工業	41,000	237.00	9,717,000
日本パーカラライジング	49,800	1,324.00	65,935,200
高压ガス工業	15,700	714.00	11,209,800
四国化成工業	14,000	1,001.00	14,014,000
戸田工業	27,000	285.00	7,695,000
ステラ ケミファ	4,900	3,000.00	14,700,000
保土谷化学工業	3,800	2,821.00	10,719,800
日本触媒	15,400	7,010.00	107,954,000
大日精化工業	40,000	607.00	24,280,000
カネカ	132,000	911.00	120,252,000
三菱瓦斯化学	91,100	1,734.00	157,967,400
三井化学	444,000	529.00	234,876,000
J S R	98,300	1,646.00	161,801,800
東京応化工業	18,500	3,825.00	70,762,500
大阪有機化学工業	8,400	809.00	6,795,600
三菱ケミカルホールディングス	656,600	719.50	472,423,700
K Hネオケム	12,600	1,225.00	15,435,000
ダイセル	132,200	1,260.00	166,572,000
住友ベークライト	88,000	617.00	54,296,000
積水化学工業	221,100	1,732.00	382,945,200
日本ゼオン	83,000	1,027.00	85,241,000
アイカ工業	31,400	3,010.00	94,514,000
宇部興産	494,000	238.00	117,572,000
積水樹脂	14,800	1,734.00	25,663,200
タキロン	23,000	503.00	11,569,000
旭有機材	39,000	217.00	8,463,000
日立化成	54,200	2,510.00	136,042,000
ニチバン	11,000	845.00	9,295,000
リケンテクノス	22,400	549.00	12,297,600
大倉工業	26,000	511.00	13,286,000

積水化成成品工業	15,200	801.00	12,175,200
群栄化学工業	2,700	3,000.00	8,100,000
ダイキョーニシカワ	17,300	1,420.00	24,566,000
日本化薬	64,000	1,328.00	84,992,000
カーリットホールディングス	12,100	534.00	6,461,400
日本精化	10,800	819.00	8,845,200
扶桑化学工業	7,000	2,542.00	17,794,000
A D E K A	42,300	1,539.00	65,099,700
日油	79,000	1,059.00	83,661,000
花王	248,600	5,267.00	1,309,376,200
第一工業製薬	27,000	353.00	9,531,000
三洋化成工業	5,900	4,830.00	28,497,000
大日本塗料	61,000	217.00	13,237,000
日本ペイントホールディングス	75,300	3,610.00	271,833,000
関西ペイント	102,500	2,095.00	214,737,500
中国塗料	28,700	779.00	22,357,300
日本特殊塗料	7,600	1,383.00	10,510,800
藤倉化成	16,500	613.00	10,114,500
太陽ホールディングス	7,900	4,430.00	34,997,000
D I C	38,600	3,535.00	136,451,000
サカタインクス	19,500	1,498.00	29,211,000
東洋インキS Cホールディングス	93,000	520.00	48,360,000
T & K T O K A	8,200	965.00	7,913,000
富士フィルムホールディングス	193,900	4,249.00	823,881,100
資生堂	185,900	2,909.00	540,783,100
ライオン	121,000	1,860.00	225,060,000
高砂香料工業	6,500	3,090.00	20,085,000
マンダム	9,600	4,910.00	47,136,000
ミルボン	5,300	4,640.00	24,592,000
ファンケル	20,700	1,581.00	32,726,700
コーセー	15,800	9,170.00	144,886,000
シーズ・ホールディングス	12,700	2,960.00	37,592,000
ポーラ・オルビスホールディングス	10,000	8,870.00	88,700,000
ノエビアホールディングス	5,800	3,580.00	20,764,000
エステー	7,900	1,393.00	11,004,700
コニシ	15,200	1,277.00	19,410,400
長谷川香料	12,000	1,944.00	23,328,000
星光P M C	6,000	1,206.00	7,236,000
小林製薬	27,100	5,010.00	135,771,000
荒川化学工業	8,900	1,583.00	14,088,700
メック	8,600	991.00	8,522,600
日本高純度化学	3,700	2,526.00	9,346,200

タカラバイオ	20,900	1,461.00	30,534,900
JCU	3,100	5,000.00	15,500,000
新田ゼラチン	8,800	734.00	6,459,200
デクセリアルズ	25,700	970.00	24,929,000
アース製薬	6,800	4,750.00	32,300,000
イハラケミカル工業	13,900	1,037.00	14,414,300
北興化学工業	16,000	371.00	5,936,000
大成ラミック	3,700	2,971.00	10,992,700
クミアイ化学工業	21,200	680.00	14,416,000
日本農薬	23,200	615.00	14,268,000
アキレス	8,800	1,597.00	14,053,600
有沢製作所	18,500	629.00	11,636,500
日東電工	70,600	7,896.00	557,457,600
レック	3,400	3,340.00	11,356,000
きもと	21,700	247.00	5,359,900
藤森工業	7,200	2,763.00	19,893,600
前澤化成工業	7,700	1,174.00	9,039,800
JSP	4,700	2,848.00	13,385,600
エフピコ	8,500	5,690.00	48,365,000
天馬	6,700	1,857.00	12,441,900
信越ポリマー	19,000	763.00	14,497,000
東リ	27,100	380.00	10,298,000
ニフコ	17,200	6,280.00	108,016,000
日本バルカー工業	9,100	1,492.00	13,577,200
ユニ・チャーム	198,400	2,434.50	483,004,800
協和発酵キリン	116,600	1,632.00	190,291,200
武田薬品工業	366,600	4,685.00	1,717,521,000
アステラス製薬	999,600	1,579.50	1,578,868,200
大日本住友製薬	69,000	1,869.00	128,961,000
塩野義製薬	132,400	5,410.00	716,284,000
田辺三菱製薬	113,600	2,151.00	244,353,600
あすか製薬	10,900	1,697.00	18,497,300
日本新薬	22,500	5,320.00	119,700,000
中外製薬	96,900	3,215.00	311,533,500
科研製薬	18,400	6,080.00	111,872,000
エーザイ	120,500	6,609.00	796,384,500
ロート製薬	48,200	1,616.00	77,891,200
小野薬品工業	222,600	2,533.50	563,957,100
久光製薬	27,700	5,500.00	152,350,000
持田製薬	6,800	7,950.00	54,060,000
参天製薬	180,100	1,396.00	251,419,600
扶桑薬品工業	4,100	2,762.00	11,324,200



日本ケミファ	1,800	5,350.00	9,630,000
ツムラ	33,200	3,095.00	102,754,000
日医工	23,600	1,581.00	37,311,600
キッセイ薬品工業	17,600	2,685.00	47,256,000
生化学工業	18,400	1,637.00	30,120,800
栄研化学	8,400	2,991.00	25,124,400
鳥居薬品	6,600	2,381.00	15,714,600
JCRファーマ	7,700	2,860.00	22,022,000
東和薬品	4,600	4,125.00	18,975,000
富士製薬工業	3,800	2,640.00	10,032,000
沢井製薬	16,800	6,130.00	102,984,000
ゼリア新薬工業	20,200	1,857.00	37,511,400
第一三共	288,100	2,382.00	686,254,200
キョーリン製薬ホールディングス	24,000	2,402.00	57,648,000
大幸薬品	5,500	1,879.00	10,334,500
ダイト	6,300	2,002.00	12,612,600
大塚ホールディングス	210,300	4,647.00	977,264,100
大正製薬ホールディングス	20,800	9,760.00	203,008,000
ペプチドリーム	16,800	5,700.00	95,760,000
日本コークス工業	97,300	100.00	9,730,000
昭和シェル石油	87,800	1,021.00	89,643,800
ニチレキ	13,200	905.00	11,946,000
東燃ゼネラル石油	160,000	1,089.00	174,240,000
ユシロ化学工業	6,800	1,400.00	9,520,000
ビーピー・カストロール	5,300	1,472.00	7,801,600
MORESCO	4,700	1,630.00	7,661,000
出光興産	46,600	2,588.00	120,600,800
JXホールディングス	1,084,000	436.40	473,057,600
コスモエネルギーホールディングス	28,700	1,450.00	41,615,000
横浜ゴム	59,200	2,067.00	122,366,400
東洋ゴム工業	52,200	1,397.00	72,923,400
ブリヂストン	330,000	4,367.00	1,441,110,000
住友ゴム工業	91,500	1,889.00	172,843,500
藤倉ゴム工業	10,400	664.00	6,905,600
オカモト	30,000	1,069.00	32,070,000
ニッタ	8,900	2,945.00	26,210,500
住友理工	18,400	1,016.00	18,694,400
三ツ星ベルト	24,000	1,010.00	24,240,000
バンドー化学	18,200	1,016.00	18,491,200
日東紡績	80,000	445.00	35,600,000
旭硝子	481,000	743.00	357,383,000
日本板硝子	32,700	805.00	26,323,500

日本山村硝子	53,000	192.00	10,176,000
日本電気硝子	204,000	610.00	124,440,000
住友大阪セメント	184,000	404.00	74,336,000
太平洋セメント	592,000	358.00	211,936,000
日本ヒューム	12,000	702.00	8,424,000
日本コンクリート工業	26,400	343.00	9,055,200
三谷セキサン	5,500	2,732.00	15,026,000
アジアパイルホールディングス	15,600	508.00	7,924,800
東海カーボン	91,000	381.00	34,671,000
日本カーボン	53,000	248.00	13,144,000
東洋炭素	6,300	1,687.00	10,628,100
ノリタケカンパニーリミテド	5,800	2,588.00	15,010,400
TOTO	71,700	4,385.00	314,404,500
日本碍子	123,600	2,186.00	270,189,600
日本特殊陶業	84,400	2,346.00	198,002,400
MARUWA	3,900	3,985.00	15,541,500
品川リフラクトリーズ	33,000	253.00	8,349,000
黒崎播磨	26,000	318.00	8,268,000
ニッカトー	10,200	419.00	4,273,800
フジインコーポレーテッド	8,600	1,978.00	17,010,800
ニチアス	51,000	1,107.00	56,457,000
ニチハ	13,300	2,876.00	38,250,800
新日鐵住金	441,500	2,453.00	1,082,999,500
神戸製鋼所	168,800	1,079.00	182,135,200
中山製鋼所	12,400	708.00	8,779,200
合同製鐵	5,900	2,172.00	12,814,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	267,500	1,670.00	446,725,000
日新製鋼	44,900	1,465.00	65,778,500
東京製鐵	49,600	825.00	40,920,000
共英製鋼	10,400	2,074.00	21,569,600
大和工業	19,700	3,250.00	64,025,000
東京鐵鋼	23,000	468.00	10,764,000
大阪製鐵	6,400	2,085.00	13,344,000
淀川製鋼所	13,100	3,160.00	41,396,000
東洋鋼鈹	25,900	376.00	9,738,400
丸一鋼管	32,500	3,685.00	119,762,500
モリ工業	3,900	1,929.00	7,523,100
大同特殊鋼	165,000	469.00	77,385,000
日本冶金工業	82,400	196.00	16,150,400
山陽特殊製鋼	59,000	573.00	33,807,000
愛知製鋼	5,700	5,280.00	30,096,000
日立金属	99,400	1,495.00	148,603,000

大平洋金属	63,000	382.00	24,066,000
新日本電工	59,800	228.00	13,634,400
栗本鐵工所	5,300	2,375.00	12,587,500
虹技	21,000	261.00	5,481,000
三菱製鋼	69,000	227.00	15,663,000
日亜鋼業	21,700	271.00	5,880,700
シンニッタン	10,800	605.00	6,534,000
大紀アルミニウム工業所	20,000	501.00	10,020,000
日本軽金属ホールディングス	224,800	255.00	57,324,000
三井金属鉱業	272,000	266.00	72,352,000
東邦亜鉛	58,000	439.00	25,462,000
三菱マテリアル	61,000	3,385.00	206,485,000
住友金属鉱山	254,000	1,528.00	388,112,000
D O W Aホールディングス	109,000	878.00	95,702,000
古河機械金属	153,000	207.00	31,671,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,300	1,610.00	18,193,000
東邦チタニウム	18,700	760.00	14,212,000
U A C J	125,000	330.00	41,250,000
古河電気工業	33,000	3,535.00	116,655,000
住友電気工業	369,200	1,602.50	591,643,000
フジクラ	130,200	617.00	80,333,400
タツタ電線	20,700	463.00	9,584,100
平河ヒューテック	5,900	1,379.00	8,136,100
リョービ	61,000	457.00	27,877,000
アーレスティ	12,500	1,047.00	13,087,500
アサヒホールディングス	14,900	2,018.00	30,068,200
稲葉製作所	6,600	1,328.00	8,764,800
宮地エンジニアリンググループ	37,000	204.00	7,548,000
トーカロ	7,000	2,477.00	17,339,000
S U M C O	102,700	1,253.00	128,683,100
川田テクノロジーズ	2,200	6,700.00	14,740,000
東洋製罐グループホールディングス	69,300	2,154.00	149,272,200
ホッカカンホールディングス	31,000	407.00	12,617,000
コロナ	7,300	1,192.00	8,701,600
横河ブリッジホールディングス	17,700	1,311.00	23,204,700
駒井ハルテック	3,200	2,097.00	6,710,400
三和ホールディングス	97,200	1,130.00	109,836,000
文化シャッター	27,600	869.00	23,984,400
三協立山	13,000	1,562.00	20,306,000
アルインコ	8,900	1,003.00	8,926,700
L I X I Lグループ	136,200	2,544.00	346,492,800
日本ファイルコン	9,600	574.00	5,510,400

ノーリツ	19,100	2,034.00	38,849,400
長府製作所	10,400	2,661.00	27,674,400
リンナイ	16,600	9,730.00	161,518,000
日東精工	20,000	429.00	8,580,000
岡部	21,000	1,010.00	21,210,000
ジーテクト	10,200	2,117.00	21,593,400
東プレ	18,600	2,704.00	50,294,400
高周波熱錬	19,000	908.00	17,252,000
東京製綱	7,400	2,108.00	15,599,200
パイオラックス	4,900	6,870.00	33,663,000
日本発條	93,000	1,072.00	99,696,000
三益半導体工業	8,500	1,371.00	11,653,500
日本製鋼所	32,800	2,033.00	66,682,400
三浦工業	40,500	1,726.00	69,903,000
タクマ	31,000	960.00	29,760,000
ツガミ	28,000	630.00	17,640,000
オークマ	64,000	1,001.00	64,064,000
東芝機械	58,000	430.00	24,940,000
アマダホールディングス	131,100	1,273.00	166,890,300
アイダエンジニアリング	27,700	1,049.00	29,057,300
滝澤鉄工所	43,000	153.00	6,579,000
富士機械製造	29,400	1,298.00	38,161,200
牧野フライス製作所	48,000	808.00	38,784,000
オーエスジー	44,800	2,261.00	101,292,800
旭ダイヤモンド工業	28,500	844.00	24,054,000
D M G 森精機	58,200	1,322.00	76,940,400
ソディック	25,300	880.00	22,264,000
ディスコ	11,400	13,560.00	154,584,000
日東工器	5,800	2,451.00	14,215,800
O K K	54,000	117.00	6,318,000
津田駒工業	32,000	155.00	4,960,000
島精機製作所	12,800	3,460.00	44,288,000
フリュー	2,400	3,350.00	8,040,000
日阪製作所	15,300	815.00	12,469,500
やまびこ	17,800	1,340.00	23,852,000
ペガサスミシン製造	11,300	653.00	7,378,900
ナブテスコ	50,900	2,908.00	148,017,200
三井海洋開発	10,000	1,740.00	17,400,000
レオン自動機	9,100	894.00	8,135,400
S M C	29,300	32,520.00	952,836,000
新川	10,100	679.00	6,857,900
ホソカワミクロン	19,000	686.00	13,034,000

ユニオンツール	4,200	2,826.00	11,869,200
オイレス工業	12,600	2,066.00	26,031,600
日精エー・エス・ピー機械	3,500	2,374.00	8,309,000
サトーホールディングス	12,300	2,258.00	27,773,400
日精樹脂工業	8,500	1,039.00	8,831,500
ワイエイシイ	4,500	1,225.00	5,512,500
小松製作所	451,400	2,633.50	1,188,761,900
住友重機械工業	285,000	689.00	196,365,000
日立建機	43,600	2,354.00	102,634,400
日工	4,000	1,988.00	7,952,000
巴工業	5,500	1,519.00	8,354,500
井関農機	102,000	227.00	23,154,000
TOWA	8,800	1,341.00	11,800,800
丸山製作所	34,000	193.00	6,562,000
北川鉄工所	5,200	2,279.00	11,850,800
ローツェ	3,700	1,658.00	6,134,600
クボタ	469,400	1,727.50	810,888,500
三菱化工機	38,000	207.00	7,866,000
月島機械	18,100	1,250.00	22,625,000
帝国電機製作所	9,000	869.00	7,821,000
新東工業	22,500	922.00	20,745,000
澁谷工業	8,300	2,220.00	18,426,000
アイチ コーポレーション	14,900	849.00	12,650,100
小森コーポレーション	23,300	1,462.00	34,064,600
鶴見製作所	7,800	1,721.00	13,423,800
住友精密工業	22,000	348.00	7,656,000
荏原製作所	40,700	2,974.00	121,041,800
西島製作所	11,000	1,083.00	11,913,000
北越工業	12,400	776.00	9,622,400
ダイキン工業	127,400	10,715.00	1,365,091,000
オルガノ	22,000	472.00	10,384,000
トーヨーカネツ	46,000	354.00	16,284,000
栗田工業	55,300	2,378.00	131,503,400
椿本チエイン	55,000	900.00	49,500,000
大同工業	28,000	242.00	6,776,000
アネスト岩田	17,300	1,136.00	19,652,800
ダイフク	46,700	2,210.00	103,207,000
加藤製作所	5,200	2,936.00	15,267,200
タダノ	49,500	1,218.00	60,291,000
フジテック	27,000	1,255.00	33,885,000
C K D	28,000	1,376.00	38,528,000
キトー	13,300	1,118.00	14,869,400

平和	28,200	2,461.00	69,400,200
理想科学工業	9,200	1,979.00	18,206,800
SANKYO	25,900	3,615.00	93,628,500
日本金銭機械	9,200	1,556.00	14,315,200
マースエンジニアリング	5,800	2,055.00	11,919,000
福島工業	5,700	3,300.00	18,810,000
ダイコク電機	4,500	1,706.00	7,677,000
竹内製作所	17,000	2,438.00	41,446,000
アマノ	28,500	1,919.00	54,691,500
JUKI	15,800	973.00	15,373,400
サンデンホールディングス	58,000	365.00	21,170,000
蛇の目マシン工業	10,600	796.00	8,437,600
マックス	14,000	1,346.00	18,844,000
グローリー	30,000	3,735.00	112,050,000
新晃工業	7,300	1,322.00	9,650,600
大和冷機工業	15,600	897.00	13,993,200
セガサミーホールディングス	92,900	1,710.00	158,859,000
日本ピストンリング	4,800	1,870.00	8,976,000
リケン	4,400	4,180.00	18,392,000
T P R	10,400	3,200.00	33,280,000
ツバキ・ナカシマ	10,900	1,678.00	18,290,200
ホシザキ	20,400	9,690.00	197,676,000
大豊工業	7,900	1,600.00	12,640,000
日本精工	191,600	1,246.00	238,733,600
NTN	217,000	429.00	93,093,000
ジェイテクト	99,300	1,830.00	181,719,000
不二越	97,000	439.00	42,583,000
日本トムソン	32,100	430.00	13,803,000
THK	66,100	2,461.00	162,672,100
ユーシン精機	4,500	2,643.00	11,893,500
前澤給装工業	5,100	1,497.00	7,634,700
イーグル工業	10,200	1,525.00	15,555,000
日本ピラー工業	10,600	1,219.00	12,921,400
キッツ	44,800	659.00	29,523,200
日立工機	24,600	1,046.00	25,731,600
マキタ	60,800	7,750.00	471,200,000
日立造船	75,500	607.00	45,828,500
三菱重工業	1,566,000	506.80	793,648,800
I H I	719,000	317.00	227,923,000
スター精密	16,400	1,556.00	25,518,400
日清紡ホールディングス	52,200	1,108.00	57,837,600
イビデン	65,600	1,554.00	101,942,400

コニカミノルタ	218,100	1,092.00	238,165,200
ブラザー工業	120,900	1,956.00	236,480,400
ミネベア	151,100	1,134.00	171,347,400
日立製作所	2,243,000	609.30	1,366,659,900
東芝	2,090,000	425.20	888,668,000
三菱電機	996,100	1,576.50	1,570,351,650
富士電機	282,000	562.00	158,484,000
東洋電機製造	5,000	1,558.00	7,790,000
安川電機	108,100	1,755.00	189,715,500
シンフォニアテクノロジー	64,000	244.00	15,616,000
明電舎	87,000	365.00	31,755,000
オリジン電気	23,000	306.00	7,038,000
山洋電気	25,000	736.00	18,400,000
デンヨー	9,600	1,454.00	13,958,400
東芝テック	59,000	565.00	33,335,000
芝浦メカトロニクス	21,000	264.00	5,544,000
マブチモーター	26,300	6,370.00	167,531,000
日本電産	121,100	10,240.00	1,240,064,000
東光高岳	5,200	1,993.00	10,363,600
ダブル・スコープ	9,300	1,898.00	17,651,400
ダイヘン	51,000	716.00	36,516,000
田淵電機	15,800	366.00	5,782,800
ヤーマン	1,400	4,110.00	5,754,000
JVCケンウッド	70,400	318.00	22,387,200
ミマキエンジニアリング	10,100	618.00	6,241,800
第一精工	5,200	1,371.00	7,129,200
日新電機	19,100	1,303.00	24,887,300
大崎電気工業	19,000	1,151.00	21,869,000
オムロン	99,100	4,220.00	418,202,000
日東工業	13,600	1,609.00	21,882,400
I D E C	13,800	1,020.00	14,076,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	178,000	461.00	82,058,000
サクサホールディングス	30,000	219.00	6,570,000
メルコホールディングス	5,400	2,925.00	15,795,000
テクノメディカ	2,800	1,789.00	5,009,200
日本電気	1,284,000	298.00	382,632,000
富士通	900,000	674.80	607,320,000
沖電気工業	40,300	1,542.00	62,142,600
電気興業	27,000	581.00	15,687,000
サンケン電気	56,000	485.00	27,160,000
アイホン	6,000	1,848.00	11,088,000
ルネサスエレクトロニクス	47,900	856.00	41,002,400

セイコーエプソン	138,800	2,293.00	318,268,400
ワコム	74,400	307.00	22,840,800
アルバック	17,200	3,435.00	59,082,000
E I Z O	9,200	3,370.00	31,004,000
ジャパンディスプレイ	151,200	265.00	40,068,000
日本信号	26,200	918.00	24,051,600
京三製作所	28,000	384.00	10,752,000
能美防災	10,400	1,799.00	18,709,600
ホーチキ	7,700	1,376.00	10,595,200
エレコム	8,400	1,961.00	16,472,400
日本無線	6,200	1,407.00	8,723,400
パナソニック	1,067,400	1,164.00	1,242,453,600
アンリツ	69,000	579.00	39,951,000
富士通ゼネラル	32,000	2,252.00	72,064,000
日立国際電気	24,300	2,283.00	55,476,900
ソニー	659,700	3,288.00	2,169,093,600
T D K	52,600	7,690.00	404,494,000
ミツミ電機	36,300	666.00	24,175,800
タムラ製作所	37,000	441.00	16,317,000
アルプス電気	86,300	2,873.00	247,939,900
池上通信機	42,000	148.00	6,216,000
パイオニア	141,800	236.00	33,464,800
日本電波工業	12,100	839.00	10,151,900
日本トリム	2,500	4,270.00	10,675,000
ローランド ディー . ジー .	5,100	2,877.00	14,672,700
フォスター電機	11,100	2,108.00	23,398,800
クラリオン	50,000	372.00	18,600,000
S M K	26,000	429.00	11,154,000
ヨコオ	8,600	798.00	6,862,800
ホシデン	28,800	935.00	26,928,000
ヒロセ電機	15,100	13,690.00	206,719,000
日本航空電子工業	30,000	1,540.00	46,200,000
T O A	12,100	957.00	11,579,700
日立マクセル	13,900	2,005.00	27,869,500
古野電気	13,600	797.00	10,839,200
ユニデンホールディングス	40,000	157.00	6,280,000
アルパイン	22,600	1,475.00	33,335,000
スミダコーポレーション	9,200	1,030.00	9,476,000
アイコム	6,000	1,960.00	11,760,000
リオン	4,700	1,513.00	7,111,100
本多通信工業	3,700	1,378.00	5,098,600
船井電機	11,400	944.00	10,761,600



横河電機	101,300	1,585.00	160,560,500
新電元工業	37,000	433.00	16,021,000
アズビル	28,300	3,100.00	87,730,000
日本光電工業	39,200	2,566.00	100,587,200
チノー	6,000	1,044.00	6,264,000
共和電業	17,900	400.00	7,160,000
堀場製作所	18,400	5,090.00	93,656,000
アドバンテスト	63,800	1,551.00	98,953,800
エスベック	9,000	1,253.00	11,277,000
パナソニック デバイスSUNX	10,500	663.00	6,961,500
キーエンス	21,200	78,230.00	1,658,476,000
日置電機	5,800	2,067.00	11,988,600
シスメックス	72,400	6,890.00	498,836,000
日本マイクロニクス	17,800	1,007.00	17,924,600
メガチップス	8,900	2,709.00	24,110,100
OBARA GROUP	5,500	5,280.00	29,040,000
コーセル	13,500	1,162.00	15,687,000
イリソ電子工業	3,000	6,730.00	20,190,000
オブテックス	7,100	2,864.00	20,334,400
千代田インテグレ	5,300	2,294.00	12,158,200
アイ・オー・データ機器	3,600	1,283.00	4,618,800
レーザーテック	11,200	2,091.00	23,419,200
スタンレー電気	66,700	3,155.00	210,438,500
岩崎電気	44,000	174.00	7,656,000
ウシオ電機	57,100	1,379.00	78,740,900
ヘリオス テクノ ホールディング	12,400	445.00	5,518,000
日本セラミック	7,800	2,107.00	16,434,600
遠藤照明	7,400	853.00	6,312,200
古河電池	8,000	809.00	6,472,000
山一電機	9,700	1,079.00	10,466,300
図研	7,300	1,106.00	8,073,800
日本電子	35,000	451.00	15,785,000
カシオ計算機	78,400	1,495.00	117,208,000
ファナック	94,700	19,305.00	1,828,183,500
日本シイエムケイ	22,600	600.00	13,560,000
エンプラス	4,500	3,295.00	14,827,500
ローム	45,100	6,250.00	281,875,000
浜松ホトニクス	72,800	3,035.00	220,948,000
三井ハイテック	13,900	680.00	9,452,000
新光電気工業	34,500	703.00	24,253,500
京セラ	153,200	5,436.00	832,795,200
太陽誘電	45,800	1,245.00	57,021,000

村田製作所	98,000	15,425.00	1,511,650,000	
ユーシン	14,100	734.00	10,349,400	
双葉電子工業	15,300	1,782.00	27,264,600	
北陸電気工業	50,000	128.00	6,400,000	
ニチコン	29,000	993.00	28,797,000	
日本ケミコン	84,000	232.00	19,488,000	
K O A	14,100	1,059.00	14,931,900	
市光工業	23,000	377.00	8,671,000	
小糸製作所	55,800	5,960.00	332,568,000	
ミツバ	17,400	1,628.00	28,327,200	
S C R E E Nホールディングス	19,200	6,820.00	130,944,000	
キャノン電子	7,900	1,708.00	13,493,200	
キャノン	502,400	3,261.00	1,638,326,400	
リコー	280,100	921.00	257,972,100	
東京エレクトロン	62,300	10,475.00	652,592,500	
トヨタ紡織	32,800	2,601.00	85,312,800	
芦森工業	33,000	158.00	5,214,000	
ユニプレス	18,700	2,191.00	40,971,700	
豊田自動織機	84,600	5,360.00	453,456,000	
モリタホールディングス	16,800	1,638.00	27,518,400	
三櫻工業	15,000	731.00	10,965,000	
デンソー	230,600	4,980.00	1,148,388,000	
東海理化電機製作所	25,100	2,243.00	56,299,300	
三井造船	348,000	164.00	57,072,000	
川崎重工業	727,000	361.00	262,447,000	
名村造船所	28,700	714.00	20,491,800	
日本車輛製造	39,000	284.00	11,076,000	
ニチユ三菱フォークリフト	12,300	766.00	9,421,800	
日産自動車	1,119,400	1,056.50	1,182,646,100	
いすゞ自動車	271,500	1,349.00	366,253,500	
トヨタ自動車	1,162,400	6,649.00	7,728,797,600	代用有価証券 500,000株
日野自動車	133,100	1,161.00	154,529,100	
三菱自動車工業	343,000	529.00	181,447,000	
エフテック	6,600	1,286.00	8,487,600	
武蔵精密工業	11,100	2,836.00	31,479,600	
日産車体	41,600	1,129.00	46,966,400	
新明和工業	38,000	962.00	36,556,000	
極東開発工業	18,900	1,480.00	27,972,000	
日信工業	20,800	1,680.00	34,944,000	
トピー工業	7,900	2,884.00	22,783,600	
ティラド	45,000	245.00	11,025,000	
タチエス	16,200	1,700.00	27,540,000	

N O K	45,600	2,275.00	103,740,000
フタバ産業	29,700	692.00	20,552,400
K Y B	105,000	520.00	54,600,000
大同メタル工業	13,500	1,090.00	14,715,000
プレス工業	51,100	499.00	25,498,900
ミクニ	19,100	369.00	7,047,900
カルソニックカンセイ	63,000	1,754.00	110,502,000
太平洋工業	19,700	1,430.00	28,171,000
ケーヒン	21,600	1,870.00	40,392,000
河西工業	13,200	1,260.00	16,632,000
アイシン精機	85,200	4,890.00	416,628,000
富士機工	14,100	420.00	5,922,000
マツダ	296,500	1,834.00	543,781,000
今仙電機製作所	10,800	932.00	10,065,600
本田技研工業	841,200	3,332.00	2,802,878,400
スズキ	185,500	3,680.00	682,640,000
富士重工業	290,100	4,645.00	1,347,514,500
ヤマハ発動機	131,900	2,631.00	347,028,900
ショーワ	25,000	684.00	17,100,000
T B K	18,000	476.00	8,568,000
エクセディ	12,500	3,145.00	39,312,500
豊田合成	30,400	2,470.00	75,088,000
愛三工業	17,500	929.00	16,257,500
ヨロズ	9,500	1,608.00	15,276,000
エフ・シー・シー	15,600	1,978.00	30,856,800
シマノ	37,600	18,790.00	706,504,000
テイ・エス テック	21,900	3,015.00	66,028,500
ジャムコ	5,800	2,260.00	13,108,000
テルモ	142,900	4,025.00	575,172,500
日機装	32,300	1,038.00	33,527,400
島津製作所	120,000	1,743.00	209,160,000
J M S	27,000	286.00	7,722,000
ブイ・テクノロジー	1,900	11,990.00	22,781,000
東京計器	39,000	215.00	8,385,000
愛知時計電機	2,000	3,415.00	6,830,000
東京精密	17,900	3,220.00	57,638,000
マニー	12,600	2,430.00	30,618,000
ニコン	162,600	1,680.00	273,168,000
トプコン	47,100	1,699.00	80,022,900
オリンパス	148,900	4,020.00	598,578,000
理研計器	9,300	1,482.00	13,782,600
タムロン	8,700	1,919.00	16,695,300

HOYA	192,400	4,499.00	865,607,600
ノーリツ銅機	11,000	785.00	8,635,000
シチズン時計	105,900	699.00	74,024,100
リズム時計工業	51,000	185.00	9,435,000
大研医器	9,900	833.00	8,246,700
メニコン	6,500	2,901.00	18,856,500
松風	6,300	1,350.00	8,505,000
セイコーホールディングス	66,000	403.00	26,598,000
ニプロ	65,200	1,258.00	82,021,600
スノーピーク	1,700	3,295.00	5,601,500
パラマウントベッドホールディングス	9,000	4,190.00	37,710,000
トランザクション	2,200	1,785.00	3,927,000
ニホンフラッシュ	5,400	1,192.00	6,436,800
前田工織	10,000	1,228.00	12,280,000
永大産業	15,000	491.00	7,365,000
アートネイチャー	13,000	621.00	8,073,000
ダンロップスポーツ	7,600	1,050.00	7,980,000
バンダイナムコホールディングス	102,800	3,265.00	335,642,000
SHOEI	4,900	2,029.00	9,942,100
フランスベッドホールディングス	13,200	911.00	12,025,200
パイロットコーポレーション	16,400	4,735.00	77,654,000
萩原工業	3,400	2,428.00	8,255,200
トッパン・フォームズ	15,400	1,090.00	16,786,000
フジシールインターナショナル	10,400	4,630.00	48,152,000
タカラトミー	36,700	1,163.00	42,682,100
アーク	52,100	87.00	4,532,700
プロネクサス	10,200	1,041.00	10,618,200
大建工業	7,100	2,006.00	14,242,600
凸版印刷	263,000	1,037.00	272,731,000
大日本印刷	267,000	1,082.00	288,894,000
図書印刷	15,000	468.00	7,020,000
共同印刷	31,000	382.00	11,842,000
日本写真印刷	15,800	2,423.00	38,283,400
宝印刷	5,900	1,405.00	8,289,500
アシックス	92,500	2,408.00	222,740,000
ツツミ	3,700	1,814.00	6,711,800
小松ウオール工業	4,100	1,797.00	7,367,700
ヤマハ	62,700	3,485.00	218,509,500
河合楽器製作所	4,600	2,144.00	9,862,400
クリナップ	12,000	946.00	11,352,000
ピジョン	56,200	2,883.00	162,024,600
キングジム	11,000	848.00	9,328,000

リンテック	22,200	2,425.00	53,835,000
T A S A K I	3,300	1,643.00	5,421,900
イトーキ	20,000	745.00	14,900,000
任天堂	57,600	27,775.00	1,599,840,000
三菱鉛筆	7,500	5,950.00	44,625,000
タカスタンダード	18,800	1,892.00	35,569,600
コクヨ	48,600	1,335.00	64,881,000
ナカバヤシ	26,000	250.00	6,500,000
グロープライド	5,300	1,798.00	9,529,400
岡村製作所	32,100	973.00	31,233,300
美津濃	49,000	556.00	27,244,000
アデランス	18,700	722.00	13,501,400
東京電力ホールディングス	792,200	425.00	336,685,000
中部電力	308,000	1,605.50	494,494,000
関西電力	381,600	1,128.00	430,444,800
中国電力	127,800	1,302.00	166,395,600
北陸電力	91,300	1,238.00	113,029,400
東北電力	232,100	1,333.00	309,389,300
四国電力	84,300	1,091.00	91,971,300
九州電力	206,000	1,125.00	231,750,000
北海道電力	86,900	830.00	72,127,000
沖縄電力	13,700	2,324.00	31,838,800
電源開発	74,400	2,509.00	186,669,600
エフオン	4,900	933.00	4,571,700
イーレックス	4,100	2,932.00	12,021,200
東京瓦斯	1,003,000	498.70	500,196,100
大阪瓦斯	907,000	432.60	392,368,200
東邦瓦斯	234,000	906.00	212,004,000
北海道瓦斯	33,000	271.00	8,943,000
広島ガス	25,000	344.00	8,600,000
西部瓦斯	104,000	246.00	25,584,000
静岡ガス	29,100	788.00	22,930,800
メタウォーター	5,300	2,864.00	15,179,200
S B S ホールディングス	10,000	899.00	8,990,000
東武鉄道	495,000	548.00	271,260,000
相鉄ホールディングス	149,000	561.00	83,589,000
東京急行電鉄	507,000	854.00	432,978,000
京浜急行電鉄	256,000	1,229.00	314,624,000
小田急電鉄	148,800	2,237.00	332,865,600
京王電鉄	259,000	912.00	236,208,000
京成電鉄	69,900	2,714.00	189,708,600
富士急行	26,000	1,062.00	27,612,000

新京成電鉄	16,000	409.00	6,544,000
東日本旅客鉄道	180,600	9,766.00	1,763,739,600
西日本旅客鉄道	90,000	6,957.00	626,130,000
東海旅客鉄道	77,600	18,680.00	1,449,568,000
西武ホールディングス	128,800	2,051.00	264,168,800
鴻池運輸	13,000	1,553.00	20,189,000
西日本鉄道	114,000	508.00	57,912,000
ハマキョウレックス	6,900	2,052.00	14,158,800
サカイ引越センター	3,800	2,407.00	9,146,600
近鉄グループホールディングス	939,000	442.00	415,038,000
阪急阪神ホールディングス	117,900	3,615.00	426,208,500
南海電気鉄道	200,000	523.00	104,600,000
京阪ホールディングス	210,000	728.00	152,880,000
神戸電鉄	30,000	368.00	11,040,000
名古屋鉄道	339,000	561.00	190,179,000
山陽電気鉄道	35,000	588.00	20,580,000
日本通運	360,000	591.00	212,760,000
ヤマトホールディングス	167,200	2,291.50	383,138,800
山九	123,000	665.00	81,795,000
丸全昭和運輸	34,000	442.00	15,028,000
センコー	41,800	808.00	33,774,400
トナミホールディングス	24,000	346.00	8,304,000
ニッコンホールディングス	31,600	2,392.00	75,587,200
福山通運	58,000	625.00	36,250,000
セイノーホールディングス	66,300	1,271.00	84,267,300
神奈川中央交通	13,000	730.00	9,490,000
日立物流	19,000	2,339.00	44,441,000
丸和運輸機関	2,800	2,960.00	8,288,000
C & F ロジホールディングス	11,000	1,231.00	13,541,000
九州旅客鉄道	69,500	2,962.00	205,859,000
日本郵船	785,000	212.00	166,420,000
商船三井	492,000	294.00	144,648,000
川崎汽船	355,000	251.00	89,105,000
N S ユナイテッド海運	49,000	207.00	10,143,000
飯野海運	50,700	420.00	21,294,000
乾汽船	9,000	923.00	8,307,000
日本航空	168,700	3,385.00	571,049,500
A N A ホールディングス	1,743,000	317.30	553,053,900
トランコム	2,800	5,570.00	15,596,000
日新	42,000	339.00	14,238,000
三菱倉庫	61,000	1,547.00	94,367,000
三井倉庫ホールディングス	56,000	334.00	18,704,000

住友倉庫	70,000	587.00	41,090,000
澁澤倉庫	32,000	338.00	10,816,000
東陽倉庫	24,000	283.00	6,792,000
日本トランスシティ	27,000	399.00	10,773,000
安田倉庫	10,000	761.00	7,610,000
東洋埠頭	38,000	188.00	7,144,000
上組	112,000	1,050.00	117,600,000
キューソー流通システム	3,800	2,312.00	8,785,600
郵船ロジスティクス	9,500	1,114.00	10,583,000
近鉄エクスプレス	16,900	1,623.00	27,428,700
エーアイティー	7,400	1,013.00	7,496,200
NEC ネットエスアイ	10,200	2,069.00	21,103,800
システナ	8,200	1,620.00	13,284,000
デジタルアーツ	4,500	2,443.00	10,993,500
新日鉄住金ソリューションズ	15,300	2,173.00	33,246,900
コア	4,900	1,214.00	5,948,600
ソフトクリエイティブホールディングス	6,200	1,368.00	8,481,600
T I S	31,000	2,405.00	74,555,000
電算システム	4,100	1,788.00	7,330,800
グリー	56,900	608.00	34,595,200
コーエーテクモホールディングス	22,000	1,915.00	42,130,000
三菱総合研究所	4,000	3,240.00	12,960,000
ファインデックス	7,300	902.00	6,584,600
ヒト・コミュニケーションズ	3,000	1,515.00	4,545,000
K L a b	19,200	643.00	12,345,600
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	8,400	916.00	7,694,400
ネクソン	101,900	1,599.00	162,938,100
アイスタイル	15,300	746.00	11,413,800
エイチーム	5,500	2,414.00	13,277,000
テクノスジャパン	3,800	2,697.00	10,248,600
コロプラ	26,400	967.00	25,528,800
ブロードリーフ	12,200	1,363.00	16,628,600
ハーツユナイテッドグループ	5,200	1,624.00	8,444,800
メディアドゥ	2,700	1,346.00	3,634,200
VOYAGE GROUP	4,500	908.00	4,086,000
オブティム	1,100	4,975.00	5,472,500
ティーガイア	9,300	1,707.00	15,875,100
日本アジアグループ	15,000	369.00	5,535,000
豆蔵ホールディングス	8,100	1,005.00	8,140,500
テクマトリックス	3,500	1,884.00	6,594,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	193,600	254.00	49,174,400
GMOペイメントゲートウェイ	7,700	4,710.00	36,267,000

インターネットイニシアティブ	14,000	1,640.00	22,960,000
さくらインターネット	7,700	954.00	7,345,800
S R Aホールディングス	5,500	2,329.00	12,809,500
フリービット	6,400	821.00	5,254,400
コムチュア	2,000	3,310.00	6,620,000
g u m i	10,600	724.00	7,674,400
L I N E	15,500	4,410.00	68,355,000
フェイス	4,600	1,228.00	5,648,800
野村総合研究所	62,600	3,880.00	242,888,000
サイバネットシステム	9,300	632.00	5,877,600
インテージホールディングス	6,300	1,877.00	11,825,100
クレスコ	2,800	2,201.00	6,162,800
フジ・メディア・ホールディングス	96,400	1,534.00	147,877,600
オービック	31,900	5,030.00	160,457,000
ジャストシステム	15,000	1,084.00	16,260,000
T D Cソフトウェアエンジニアリング	5,000	1,123.00	5,615,000
ヤフー	660,700	416.00	274,851,200
トレンドマイクロ	49,000	4,110.00	201,390,000
日本オラクル	14,900	5,700.00	84,930,000
アルファシステムズ	4,400	1,747.00	7,686,800
フューチャー	14,700	727.00	10,686,900
C A C H o l d i n g s	9,700	901.00	8,739,700
ソフトバンク・テクノロジー	2,500	2,735.00	6,837,500
オービックビジネスコンサルタント	4,800	4,820.00	23,136,000
伊藤忠テクノソリューションズ	21,100	3,080.00	64,988,000
アイティフォー	14,900	636.00	9,476,400
大塚商会	24,800	5,570.00	138,136,000
サイボウズ	16,700	447.00	7,464,900
ソフトブレーン	14,000	392.00	5,488,000
電通国際情報サービス	6,200	1,853.00	11,488,600
デジタルガレージ	15,000	2,006.00	30,090,000
E Mシステムズ	4,400	1,542.00	6,784,800
ウェザーニューズ	3,800	3,360.00	12,768,000
WOWOW	4,600	2,994.00	13,772,400
フュージョンパートナー	6,800	1,104.00	7,507,200
イマジカ・ロボット ホールディングス	9,100	647.00	5,887,700
ネットワンシステムズ	40,800	772.00	31,497,600
アルゴグラフィックス	5,300	2,175.00	11,527,500
マーベラス	16,800	775.00	13,020,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	17,400	1,581.00	27,509,400
日本ユニシス	25,800	1,412.00	36,429,600
兼松エレクトロニクス	5,700	2,469.00	14,073,300



東京放送ホールディングス	61,100	1,789.00	109,307,900
日本テレビホールディングス	84,200	1,946.00	163,853,200
朝日放送	12,600	693.00	8,731,800
テレビ朝日ホールディングス	25,700	2,148.00	55,203,600
スカパーJ S A Tホールディングス	60,500	546.00	33,033,000
テレビ東京ホールディングス	7,700	2,225.00	17,132,500
ワイヤレスゲート	4,000	1,690.00	6,760,000
コネクシオ	8,700	1,400.00	12,180,000
日本電信電話	740,600	4,625.00	3,425,275,000
K D D I	912,800	2,999.00	2,737,487,200
光通信	11,100	10,200.00	113,220,000
N T T ドコモ	689,400	2,624.00	1,808,985,600
エムティーアイ	15,600	749.00	11,684,400
G M O インターネット	33,800	1,569.00	53,032,200
カドカワ	26,700	1,559.00	41,625,300
学研ホールディングス	35,000	330.00	11,550,000
ゼンリン	12,600	1,703.00	21,457,800
アイネット	7,100	1,087.00	7,717,700
松竹	63,000	1,236.00	77,868,000
東宝	60,300	3,285.00	198,085,500
東映	35,000	921.00	32,235,000
A O I P r o .	7,200	839.00	6,040,800
エヌ・ティ・ティ・データ	56,800	5,690.00	323,192,000
D T S	9,700	2,532.00	24,560,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	35,800	2,883.00	103,211,400
シーイーシー	6,000	1,894.00	11,364,000
カブコン	22,200	2,498.00	55,455,600
ジャステック	8,100	1,028.00	8,326,800
S C S K	25,200	3,975.00	100,170,000
日本システムウエア	3,900	1,485.00	5,791,500
アイネス	13,000	1,184.00	15,392,000
T K C	8,700	3,090.00	26,883,000
富士ソフト	13,800	2,653.00	36,611,400
N S D	19,100	1,755.00	33,520,500
コナミホールディングス	41,800	3,870.00	161,766,000
福井コンピュータホールディングス	3,000	2,569.00	7,707,000
J B C C ホールディングス	11,900	689.00	8,199,100
ミロク情報サービス	7,200	1,901.00	13,687,200
ソフトバンクグループ	415,300	6,712.00	2,787,493,600
伊藤忠食品	2,900	4,240.00	12,296,000
エレマテック	4,400	1,847.00	8,126,800
J A L U X	3,900	1,914.00	7,464,600

あらた	4,800	2,414.00	11,587,200
東京エレクトロン デバイス	5,200	1,522.00	7,914,400
フィールズ	8,300	1,350.00	11,205,000
双日	545,800	290.00	158,282,000
アルフレッサ ホールディングス	108,900	1,823.00	198,524,700
横浜冷凍	23,200	1,040.00	24,128,000
アルコニックス	6,700	1,594.00	10,679,800
神戸物産	5,100	3,025.00	15,427,500
あい ホールディングス	16,400	2,513.00	41,213,200
ダイワボウホールディングス	79,000	301.00	23,779,000
マクニカ・富士エレホールディングス	16,600	1,360.00	22,576,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	17,300	963.00	16,659,900
U K Cホールディングス	6,500	2,094.00	13,611,000
T O K A Iホールディングス	41,700	754.00	31,441,800
三洋貿易	6,000	1,535.00	9,210,000
ウイン・パートナーズ	3,700	1,851.00	6,848,700
シップヘルスケアホールディングス	17,700	2,987.00	52,869,900
コメダホールディングス	12,800	1,728.00	22,118,400
小野建	9,400	1,223.00	11,496,200
佐島電機	11,200	712.00	7,974,400
伯東	8,400	1,004.00	8,433,600
コンドーテック	10,800	809.00	8,737,200
ナガイレーベン	13,400	2,372.00	31,784,800
三菱食品	9,700	3,295.00	31,961,500
松田産業	7,300	1,461.00	10,665,300
第一興商	15,300	4,465.00	68,314,500
メディバルホールディングス	92,100	1,637.00	150,767,700
萩原電気	4,100	2,087.00	8,556,700
アズワン	7,300	4,875.00	35,587,500
尾家産業	5,400	1,032.00	5,572,800
シモジマ	6,900	1,093.00	7,541,700
ドウシシャ	11,000	2,064.00	22,704,000
小津産業	3,300	2,096.00	6,916,800
高速	8,300	1,040.00	8,632,000
黒田電気	12,400	2,298.00	28,495,200
丸文	10,900	684.00	7,455,600
ハピネット	8,800	1,319.00	11,607,200
日本ライフライン	8,000	2,585.00	20,680,000
エクセル	5,100	1,437.00	7,328,700
マルカキカイ	4,800	1,414.00	6,787,200
I D O M	26,000	568.00	14,768,000
日本エム・ディ・エム	8,300	839.00	6,963,700

進和	7,200	1,673.00	12,045,600
シークス	6,600	3,830.00	25,278,000
オーハシテクニカ	6,600	1,353.00	8,929,800
伊藤忠商事	675,600	1,562.00	1,055,287,200
丸紅	909,800	626.30	569,807,740
長瀬産業	55,600	1,434.00	79,730,400
蝶理	6,700	1,709.00	11,450,300
豊田通商	101,900	2,859.00	291,332,100
三共生興	20,300	381.00	7,734,300
兼松	195,000	189.00	36,855,000
三井物産	834,400	1,541.50	1,286,227,600
日本紙パルプ商事	47,000	348.00	16,356,000
日立ハイテクノロジーズ	32,000	4,510.00	144,320,000
カメイ	13,200	1,044.00	13,780,800
スターゼン	4,000	4,740.00	18,960,000
山善	35,100	897.00	31,484,700
住友商事	581,200	1,365.00	793,338,000
内田洋行	27,000	458.00	12,366,000
三菱商事	692,100	2,471.50	1,710,525,150
第一実業	24,000	671.00	16,104,000
キャノンマーケティングジャパン	26,600	1,802.00	47,933,200
西華産業	35,000	328.00	11,480,000
佐藤商事	11,600	824.00	9,558,400
菱洋エレクトロ	9,600	1,376.00	13,209,600
東京産業	12,000	491.00	5,892,000
ユアサ商事	8,600	2,813.00	24,191,800
阪和興業	93,000	743.00	69,099,000
カナデン	10,800	1,014.00	10,951,200
菱電商事	16,000	742.00	11,872,000
フルサト工業	6,200	1,604.00	9,944,800
岩谷産業	105,000	619.00	64,995,000
すてきナイスグループ	56,000	152.00	8,512,000
三愛石油	25,000	787.00	19,675,000
稲畑産業	21,800	1,209.00	26,356,200
ワキタ	20,400	939.00	19,155,600
東邦ホールディングス	29,800	2,216.00	66,036,800
サンゲツ	32,300	1,997.00	64,503,100
ミツウロコグループホールディングス	16,700	704.00	11,756,800
シナネンホールディングス	5,100	1,991.00	10,154,100
伊藤忠エネクス	20,100	864.00	17,366,400
サンリオ	29,300	2,014.00	59,010,200
サンワテクノス	8,600	937.00	8,058,200

リョーサン	14,100	3,440.00	48,504,000
新光商事	11,200	1,212.00	13,574,400
トーホー	5,200	2,493.00	12,963,600
三信電気	11,500	939.00	10,798,500
東陽テクニカ	14,200	955.00	13,561,000
モスフードサービス	11,700	3,405.00	39,838,500
加賀電子	8,500	1,893.00	16,090,500
ソーダニッカ	14,500	503.00	7,293,500
立花エレクトック	7,400	1,326.00	9,812,400
PALTA C	14,600	2,547.00	37,186,200
三谷産業	15,900	341.00	5,421,900
太平洋興発	47,000	97.00	4,559,000
ヤマタネ	6,000	1,485.00	8,910,000
日鉄住金物産	7,800	4,420.00	34,476,000
トラスコ中山	10,500	5,180.00	54,390,000
オートバックスセブン	34,800	1,660.00	57,768,000
加藤産業	14,100	2,521.00	35,546,100
イノテック	13,800	526.00	7,258,800
イエローハット	8,900	2,337.00	20,799,300
J Kホールディングス	13,400	598.00	8,013,200
日伝	4,400	3,140.00	13,816,000
杉本商事	6,700	1,526.00	10,224,200
因幡電機産業	12,700	3,875.00	49,212,500
バイテックホールディングス	5,600	1,229.00	6,882,400
ミスミグループ本社	103,800	2,046.00	212,374,800
タキヒヨー	20,000	431.00	8,620,000
スズケン	42,000	3,420.00	143,640,000
ジェコス	7,900	994.00	7,852,600
ローソン	32,000	7,920.00	253,440,000
サンエー	6,800	5,510.00	37,468,000
カワチ薬品	7,300	2,693.00	19,658,900
エービーシー・マート	16,800	6,710.00	112,728,000
ハードオフコーポレーション	6,200	1,153.00	7,148,600
アスクル	11,200	4,115.00	46,088,000
ゲオホールディングス	15,800	1,238.00	19,560,400
アダストリア	14,400	3,230.00	46,512,000
くらコーポレーション	6,000	4,900.00	29,400,000
キャンドウ	6,000	1,779.00	10,674,000
パルグループホールディングス	5,100	2,968.00	15,136,800
エディオン	35,200	1,099.00	38,684,800
サーラコーポレーション	15,100	630.00	9,513,000
ハローズ	3,400	2,364.00	8,037,600

あみやき亭	2,300	3,965.00	9,119,500
ひらまつ	16,800	620.00	10,416,000
ゲンキー	2,000	5,630.00	11,260,000
大黒天物産	2,500	4,910.00	12,275,000
ハニーズ	9,500	1,188.00	11,286,000
アルペン	8,200	2,211.00	18,130,200
クオール	10,900	1,464.00	15,957,600
ジェイアイエヌ	6,300	4,795.00	30,208,500
ビックカメラ	52,100	1,014.00	52,829,400
D C Mホールディングス	56,100	1,033.00	57,951,300
Monotaro	32,800	2,443.00	80,130,400
アークランドサービスホールディングス	3,200	2,903.00	9,289,600
J.フロント リテイリング	116,600	1,612.00	187,959,200
ドトール・日レスホールディングス	16,100	2,127.00	34,244,700
マツモトキヨシホールディングス	17,500	5,460.00	95,550,000
ブロンコビリー	4,900	3,045.00	14,920,500
スタートトゥデイ	84,800	1,757.00	148,993,600
物語コーポレーション	2,800	4,410.00	12,348,000
ココカラファイン	9,500	4,190.00	39,805,000
三越伊勢丹ホールディングス	183,300	1,261.00	231,141,300
ウエルシアホールディングス	8,900	7,130.00	63,457,000
クリエイトSDホールディングス	13,400	2,427.00	32,521,800
チムニー	3,200	2,881.00	9,219,200
シュッピン	4,300	1,276.00	5,486,800
ネクステージ	2,300	1,749.00	4,022,700
ジョイフル本田	14,900	3,215.00	47,903,500
鳥貴族	2,800	2,497.00	6,991,600
ホットランド	5,800	1,144.00	6,635,200
すかいらーく	39,400	1,600.00	63,040,000
綿半ホールディングス	4,600	1,578.00	7,258,800
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	28,200	938.00	26,451,600
ブックオフコーポレーション	8,900	800.00	7,120,000
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,600	944.00	4,342,400
あさひ	8,000	1,259.00	10,072,000
日本調剤	3,300	4,435.00	14,635,500
コスモス薬品	4,600	20,930.00	96,278,000
セブン&アイ・ホールディングス	385,700	4,435.00	1,710,579,500
薬王堂	4,800	2,214.00	10,627,200
クリエイト・レストランツ・ホールディング	24,100	1,007.00	24,268,700
ツルハホールディングス	21,200	11,680.00	247,616,000
サンマルクホールディングス	6,000	3,540.00	21,240,000
トリドールホールディングス	11,500	2,475.00	28,462,500

クスリのアオキホールディングス	8,200	4,865.00	39,893,000
メディカルシステムネットワーク	13,700	398.00	5,452,600
総合メディカル	4,700	3,475.00	16,332,500
ノジマ	11,200	1,337.00	14,974,400
カップ・クリエイト	13,400	1,236.00	16,562,400
ライトオン	8,200	1,012.00	8,298,400
良品計画	12,200	22,430.00	273,646,000
三城ホールディングス	16,700	448.00	7,481,600
アドヴァン	10,600	1,113.00	11,797,800
アルビス	3,000	2,941.00	8,823,000
コナカ	15,600	544.00	8,486,400
G - 7ホールディングス	3,100	1,352.00	4,191,200
コーナン商事	13,300	2,163.00	28,767,900
エコス	5,400	1,184.00	6,393,600
ワタミ	12,600	1,094.00	13,784,400
ドンキホーテホールディングス	59,600	4,375.00	260,750,000
西松屋チェーン	16,300	1,480.00	24,124,000
ゼンショーホールディングス	48,100	1,956.00	94,083,600
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,582.00	10,915,800
サイゼリヤ	15,100	2,765.00	41,751,500
V Tホールディングス	31,600	558.00	17,632,800
魚力	4,800	1,243.00	5,966,400
ユナイテッドアローズ	12,500	2,881.00	36,012,500
ハイデイ日高	8,300	2,701.00	22,418,300
京都きもの友禅	8,800	948.00	8,342,400
コロワイド	29,900	1,896.00	56,690,400
ピーシーデポコーポレーション	13,900	560.00	7,784,000
壱番屋	8,200	3,750.00	30,750,000
スギホールディングス	20,300	5,340.00	108,402,000
スクロール	19,700	353.00	6,954,100
ヨンドシーホールディングス	7,100	2,627.00	18,651,700
ユニー・ファミリーマートホールディングス	40,300	7,150.00	288,145,000
木曽路	11,300	2,283.00	25,797,900
サトレストランシステムズ	14,400	817.00	11,764,800
千趣会	18,700	751.00	14,043,700
ケーヨー	20,900	542.00	11,327,800
上新電機	22,000	952.00	20,944,000
日本瓦斯	17,100	3,290.00	56,259,000
ベスト電器	37,700	154.00	5,805,800
ロイヤルホールディングス	14,900	1,935.00	28,831,500
いなげや	10,100	1,425.00	14,392,500
島忠	24,100	2,951.00	71,119,100

チヨダ	10,800	2,652.00	28,641,600
ライフコーポレーション	7,000	3,245.00	22,715,000
リンガーハット	10,800	2,091.00	22,582,800
MrMax	16,200	406.00	6,577,200
AOKIホールディングス	18,200	1,339.00	24,369,800
オークワ	13,000	1,169.00	15,197,000
コメリ	14,900	2,708.00	40,349,200
青山商事	19,400	3,885.00	75,369,000
しまむら	10,700	13,620.00	145,734,000
高島屋	155,000	949.00	147,095,000
松屋	20,700	1,016.00	21,031,200
エイチ・ツー・オー リテイリング	47,600	1,711.00	81,443,600
近鉄百貨店	37,000	353.00	13,061,000
パルコ	9,400	1,018.00	9,569,200
丸井グループ	97,300	1,576.00	153,344,800
アクシアル リテイリング	7,100	3,880.00	27,548,000
イオン	379,800	1,576.00	598,564,800
イズミ	18,300	5,010.00	91,683,000
平和堂	18,500	2,263.00	41,865,500
フジ	10,300	2,224.00	22,907,200
ヤオコー	10,200	4,350.00	44,370,000
ゼビオホールディングス	12,600	1,760.00	22,176,000
ケーズホールディングス	42,800	2,112.00	90,393,600
Olympicグループ	9,100	603.00	5,487,300
日産東京販売ホールディングス	19,700	290.00	5,713,000
アインホールディングス	11,100	7,990.00	88,689,000
元気寿司	3,500	2,067.00	7,234,500
ヤマダ電機	308,200	611.00	188,310,200
アークランドサカモト	16,100	1,328.00	21,380,800
ニトリホールディングス	39,900	11,940.00	476,406,000
グルメ杵屋	9,000	997.00	8,973,000
愛眼	19,800	199.00	3,940,200
吉野家ホールディングス	33,500	1,557.00	52,159,500
松屋フーズ	4,500	3,480.00	15,660,000
サガミチェーン	12,600	1,268.00	15,976,800
関西スーパーマーケット	8,000	1,490.00	11,920,000
王将フードサービス	6,700	4,150.00	27,805,000
プレナス	10,200	2,232.00	22,766,400
ミニストップ	7,100	1,906.00	13,532,600
アークス	17,100	2,592.00	44,323,200
パローホールディングス	20,300	2,732.00	55,459,600
ベルク	4,100	4,115.00	16,871,500

大庄	6,600	1,544.00	10,190,400
ファーストリテイリング	15,400	39,570.00	609,378,000
サンドラッグ	17,600	7,960.00	140,096,000
サクスパー ホールディングス	9,600	1,214.00	11,654,400
ヤマザワ	3,100	1,739.00	5,390,900
やまや	2,000	1,590.00	3,180,000
ペルーナ	23,400	640.00	14,976,000
じもとホールディングス	71,900	191.00	13,732,900
めぶきフィナンシャルグループ	441,100	416.00	183,497,600
東京ＴＹフィナンシャルグループ	13,500	3,775.00	50,962,500
九州フィナンシャルグループ	149,900	753.00	112,874,700
ゆうちょ銀行	259,300	1,349.00	349,795,700
富山第一銀行	26,300	523.00	13,754,900
コンコルディア・フィナンシャルグループ	601,600	525.50	316,140,800
西日本フィナンシャルホールディングス	62,400	1,075.00	67,080,000
新生銀行	873,000	183.00	159,759,000
あおぞら銀行	581,000	393.00	228,333,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	6,991,500	669.80	4,682,906,700
りそなホールディングス	1,074,900	550.10	591,302,490
三井住友トラスト・ホールディングス	192,000	4,150.00	796,800,000
三井住友フィナンシャルグループ	738,600	4,206.00	3,106,551,600
第四銀行	110,000	480.00	52,800,000
北越銀行	10,300	2,549.00	26,254,700
千葉銀行	352,000	678.00	238,656,000
群馬銀行	203,600	581.00	118,291,600
武蔵野銀行	14,700	3,065.00	45,055,500
千葉興業銀行	28,400	523.00	14,853,200
筑波銀行	42,300	336.00	14,212,800
七十七銀行	143,000	539.00	77,077,000
青森銀行	74,000	376.00	27,824,000
秋田銀行	62,000	369.00	22,878,000
山形銀行	53,000	470.00	24,910,000
岩手銀行	6,100	4,610.00	28,121,000
東邦銀行	81,000	412.00	33,372,000
東北銀行	50,000	148.00	7,400,000
みちのく銀行	50,000	218.00	10,900,000
ふくおかフィナンシャルグループ	372,000	495.00	184,140,000
静岡銀行	250,000	925.00	231,250,000
十六銀行	122,000	367.00	44,774,000
スルガ銀行	93,800	2,577.00	241,722,600
八十二銀行	173,700	613.00	106,478,100
山梨中央銀行	58,000	506.00	29,348,000



大垣共立銀行	121,000	411.00	49,731,000
福井銀行	82,000	279.00	22,878,000
北國銀行	97,000	397.00	38,509,000
清水銀行	3,600	3,365.00	12,114,000
富山銀行	2,100	4,020.00	8,442,000
滋賀銀行	85,000	596.00	50,660,000
南都銀行	8,900	4,155.00	36,979,500
百五銀行	81,000	436.00	35,316,000
京都銀行	164,000	793.00	130,052,000
紀陽銀行	36,300	1,740.00	63,162,000
三重銀行	4,500	2,246.00	10,107,000
ほくほくフィナンシャルグループ	60,600	1,854.00	112,352,400
広島銀行	269,000	504.00	135,576,000
山陰合同銀行	55,500	873.00	48,451,500
中国銀行	63,800	1,546.00	98,634,800
鳥取銀行	3,100	1,774.00	5,499,400
伊予銀行	97,500	734.00	71,565,000
百十四銀行	102,000	381.00	38,862,000
四国銀行	76,000	294.00	22,344,000
阿波銀行	78,000	674.00	52,572,000
大分銀行	55,000	408.00	22,440,000
宮崎銀行	63,000	362.00	22,806,000
佐賀銀行	62,000	277.00	17,174,000
十八銀行	60,000	341.00	20,460,000
沖縄銀行	9,100	4,275.00	38,902,500
琉球銀行	19,600	1,476.00	28,929,600
セブン銀行	345,700	326.00	112,698,200
みずほフィナンシャルグループ	12,522,000	202.60	2,536,957,200
高知銀行	40,000	125.00	5,000,000
山口フィナンシャルグループ	85,000	1,190.00	101,150,000
長野銀行	3,500	2,009.00	7,031,500
名古屋銀行	7,800	3,835.00	29,913,000
北洋銀行	149,000	448.00	66,752,000
愛知銀行	3,200	6,450.00	20,640,000
第三銀行	5,300	1,825.00	9,672,500
中京銀行	4,500	2,357.00	10,606,500
大光銀行	36,000	262.00	9,432,000
愛媛銀行	12,100	1,365.00	16,516,500
トマト銀行	3,700	1,622.00	6,001,400
みなと銀行	8,700	1,948.00	16,947,600
京葉銀行	75,000	488.00	36,600,000
関西アーバン銀行	13,600	1,292.00	17,571,200

栃木銀行	52,400	497.00	26,042,800
北日本銀行	3,000	3,075.00	9,225,000
東和銀行	187,000	108.00	20,196,000
福島銀行	111,000	93.00	10,323,000
大東銀行	57,000	169.00	9,633,000
トモニホールディングス	77,200	590.00	45,548,000
フィデアホールディングス	95,800	192.00	18,393,600
池田泉州ホールディングス	98,000	494.00	48,412,000
F P G	33,500	913.00	30,585,500
S B Iホールディングス	103,900	1,432.00	148,784,800
ジャフコ	15,600	3,950.00	61,620,000
大和証券グループ本社	863,000	687.40	593,226,200
野村ホールディングス	1,885,900	614.00	1,157,942,600
岡三証券グループ	79,000	657.00	51,903,000
丸三証券	31,200	930.00	29,016,000
東洋証券	36,000	236.00	8,496,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	106,600	591.00	63,000,600
水戸証券	30,800	293.00	9,024,400
いちよし証券	20,500	820.00	16,810,000
松井証券	52,900	880.00	46,552,000
マネックスグループ	102,300	270.00	27,621,000
カブドットコム証券	71,600	366.00	26,205,600
極東証券	12,700	1,662.00	21,107,400
岩井コスモホールディングス	9,800	972.00	9,525,600
藍澤証券	19,600	630.00	12,348,000
マネーパートナーズグループ	14,000	480.00	6,720,000
かんぽ生命保険	34,800	2,309.00	80,353,200
S O M P Oホールディングス	192,500	3,728.00	717,640,000
アニコム ホールディングス	7,000	2,700.00	18,900,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	275,800	3,549.00	978,814,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	88,500	1,650.00	146,025,000
第一生命ホールディングス	555,800	1,833.50	1,019,059,300
東京海上ホールディングス	373,200	4,899.00	1,828,306,800
T & Dホールディングス	335,900	1,429.00	480,001,100
アドバンスクリエイト	3,500	1,787.00	6,254,500
全国保証	26,100	3,875.00	101,137,500
クレディセゾン	69,700	2,051.00	142,954,700
アクリーティブ	11,600	361.00	4,187,600
芙蓉総合リース	10,600	5,400.00	57,240,000
興銀リース	17,500	2,413.00	42,227,500
東京センチュリー	18,100	3,695.00	66,879,500
日本証券金融	43,200	545.00	23,544,000

アイフル	154,500	353.00	54,538,500
ポケットカード	9,800	569.00	5,576,200
リコーリース	7,400	3,500.00	25,900,000
イオンフィナンシャルサービス	58,900	1,904.00	112,145,600
アコム	184,400	547.00	100,866,800
ジャックス	53,000	531.00	28,143,000
オリエントコーポレーション	196,800	202.00	39,753,600
日立キャピタル	21,800	2,802.00	61,083,600
アプラスフィナンシャル	47,000	112.00	5,264,000
オリックス	652,000	1,781.50	1,161,538,000
三菱UFJリース	232,200	527.00	122,369,400
日本取引所グループ	286,100	1,694.00	484,653,400
イー・ギャランティ	3,300	2,495.00	8,233,500
NECキャピタルソリューション	4,500	1,710.00	7,695,000
いちご	87,300	437.00	38,150,100
日本駐車場開発	117,500	164.00	19,270,000
ヒューリック	192,200	1,074.00	206,422,800
三栄建築設計	4,300	1,714.00	7,370,200
野村不動産ホールディングス	61,400	1,852.00	113,712,800
三重交通グループホールディングス	21,100	393.00	8,292,300
サムティ	8,600	1,065.00	9,159,000
日本商業開発	5,800	1,925.00	11,165,000
プレサンスコーポレーション	14,500	1,427.00	20,691,500
ユニゾホールディングス	7,900	3,265.00	25,793,500
日本管理センター	7,700	1,379.00	10,618,300
フージャースホールディングス	16,300	607.00	9,894,100
オープンハウス	13,400	2,828.00	37,895,200
東急不動産ホールディングス	223,200	655.00	146,196,000
飯田グループホールディングス	76,300	2,218.00	169,233,400
パーク24	46,900	3,250.00	152,425,000
パラカ	3,400	2,029.00	6,898,600
三井不動産	489,000	2,690.50	1,315,654,500
三菱地所	686,000	2,305.50	1,581,573,000
平和不動産	18,100	1,634.00	29,575,400
東京建物	107,100	1,476.00	158,079,600
ダイビル	24,300	1,019.00	24,761,700
京阪神ビルディング	18,700	585.00	10,939,500
住友不動産	221,000	3,159.00	698,139,000
大京	170,000	242.00	41,140,000
テーオーシー	36,100	989.00	35,702,900
東京楽天地	18,000	506.00	9,108,000
レオパレス21	117,900	621.00	73,215,900

スターツコーポレーション	9,200	2,086.00	19,191,200
フジ住宅	15,700	724.00	11,366,800
空港施設	15,400	576.00	8,870,400
住友不動産販売	8,300	2,788.00	23,140,400
ゴールドクレスト	8,600	2,169.00	18,653,400
日神不動産	15,400	518.00	7,977,200
日本エスコン	15,500	374.00	5,797,000
タカラレーベン	41,300	675.00	27,877,500
サンヨーハウジング名古屋	7,700	991.00	7,630,700
イオンモール	60,200	1,650.00	99,330,000
トーセイ	14,400	831.00	11,966,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	58,800	986.00	57,976,800
サンフロンティア不動産	11,800	983.00	11,599,400
エフ・ジェー・ネクスト	9,700	708.00	6,867,600
日本空港ビルデング	29,600	4,255.00	125,948,000
日本工営	34,000	498.00	16,932,000
ネクスト	24,400	801.00	19,544,400
ジェイエシーリクルートメント	6,500	1,315.00	8,547,500
日本M&Aセンター	28,300	3,120.00	88,296,000
アコーディア・ゴルフ	30,600	1,199.00	36,689,400
タケエイ	10,500	897.00	9,418,500
トラスト・テック	4,500	1,505.00	6,772,500
パソナグループ	9,900	772.00	7,642,800
リンクアンドモチベーション	25,400	393.00	9,982,200
G C A	10,200	919.00	9,373,800
エス・エム・エス	13,400	2,858.00	38,297,200
テンプホールディングス	75,200	1,762.00	132,502,400
リニカル	6,300	1,309.00	8,246,700
クックパッド	22,300	1,026.00	22,879,800
学情	5,100	1,149.00	5,859,900
スタジオアリス	4,900	2,302.00	11,279,800
シミックホールディングス	6,000	1,501.00	9,006,000
総合警備保障	35,400	4,655.00	164,787,000
カカクコム	70,200	1,795.00	126,009,000
ルネサンス	6,400	1,430.00	9,152,000
ディップ	12,600	2,403.00	30,277,800
オプトホールディング	9,200	713.00	6,559,600
ツクイ	24,000	717.00	17,208,000
エムスリー	84,700	2,953.00	250,119,100
ツカダ・グローバルホールディング	9,900	719.00	7,118,100
アウトソーシング	5,600	3,625.00	20,300,000
ウェルネット	8,200	1,301.00	10,668,200

ワールドホールディングス	2,700	1,883.00	5,084,100
ディー・エヌ・エー	43,900	3,485.00	152,991,500
博報堂DYホールディングス	134,600	1,328.00	178,748,800
ぐるなび	14,200	2,426.00	34,449,200
エスアールジータカミヤ	12,400	656.00	8,134,400
ジャパンベストレスキューシステム	18,100	258.00	4,669,800
ファンコミュニケーションズ	25,100	751.00	18,850,100
ジェイコムホールディングス	2,800	1,864.00	5,219,200
WDBホールディングス	4,300	1,277.00	5,491,100
インフォマート	21,000	1,164.00	24,444,000
J Pホールディングス	34,300	264.00	9,055,200
E P Sホールディングス	12,500	1,342.00	16,775,000
プレステージ・インターナショナル	15,300	808.00	12,362,400
アミューズ	6,000	1,636.00	9,816,000
ドリームインキュベータ	3,400	2,109.00	7,170,600
クイック	6,100	944.00	5,758,400
ケネディクス	131,500	422.00	55,493,000
電通	108,600	5,230.00	567,978,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,400	744.00	4,761,600
ぴあ	3,500	2,654.00	9,289,000
イオンファンタジー	3,200	3,155.00	10,096,000
ネクシィーズグループ	4,000	1,400.00	5,600,000
みらかホールディングス	25,100	5,120.00	128,512,000
アルプス技研	4,400	2,618.00	11,519,200
日本空調サービス	12,200	566.00	6,905,200
オリエンタルランド	105,600	6,517.00	688,195,200
ダスキン	25,400	2,299.00	58,394,600
明光ネットワークジャパン	13,600	989.00	13,450,400
ファルコホールディングス	6,300	1,406.00	8,857,800
ラウンドワン	31,600	797.00	25,185,200
リゾートトラスト	38,200	2,215.00	84,613,000
ビー・エム・エル	12,800	2,634.00	33,715,200
りらいあコミュニケーションズ	16,000	1,101.00	17,616,000
リソー教育	19,200	575.00	11,040,000
ユー・エス・エス	118,400	1,831.00	216,790,400
サイバーエージェント	51,700	2,781.00	143,777,700
楽天	499,500	1,128.00	563,436,000
テー・オー・ダブリュー	10,900	646.00	7,041,400
セントラルスポーツ	4,300	2,698.00	11,601,400
フルキャストホールディングス	10,900	905.00	9,864,500
テクノプロ・ホールディングス	16,000	3,635.00	58,160,000
イー・ガーディアン	4,000	1,331.00	5,324,000

リブセンス	10,000	473.00	4,730,000
ジャパンマテリアル	3,700	3,715.00	13,745,500
ベクトル	8,300	1,206.00	10,009,800
I B J	9,100	721.00	6,561,100
アサンテ	5,200	1,699.00	8,834,800
N・フィールド	5,200	1,326.00	6,895,200
M&Aキャピタルパートナーズ	1,700	3,055.00	5,193,500
アビスト	2,100	3,455.00	7,255,500
リクルートホールディングス	212,900	4,365.00	929,308,500
日本郵政	253,000	1,417.00	358,501,000
ベルシステム24ホールディングス	15,400	933.00	14,368,200
ソラスト	5,400	1,187.00	6,409,800
リログループ	3,600	15,700.00	56,520,000
東祥	2,200	5,030.00	11,066,000
エイチ・アイ・エス	15,700	3,150.00	49,455,000
共立メンテナンス	7,900	6,930.00	54,747,000
イチネンホールディングス	12,100	1,087.00	13,152,700
建設技術研究所	8,100	1,015.00	8,221,500
スペース	6,400	1,291.00	8,262,400
東京テアトル	52,000	184.00	9,568,000
ナガワ	1,900	4,290.00	8,151,000
よみうりランド	24,000	469.00	11,256,000
東京都競馬	68,000	279.00	18,972,000
常磐興産	5,400	1,536.00	8,294,400
カナモト	13,700	2,610.00	35,757,000
東京ドーム	38,800	1,177.00	45,667,600
西尾レントオール	7,800	3,060.00	23,868,000
トランス・コスモス	11,100	2,781.00	30,869,100
乃村工藝社	20,500	1,674.00	34,317,000
藤田観光	37,000	329.00	12,173,000
KNT-CTホールディングス	61,000	147.00	8,967,000
日本管財	9,000	1,631.00	14,679,000
トーカイ	4,400	3,650.00	16,060,000
白洋舎	1,700	2,569.00	4,367,300
セコム	101,600	8,319.00	845,210,400
セントラル警備保障	5,000	2,184.00	10,920,000
丹青社	17,500	754.00	13,195,000
メイテック	12,100	4,295.00	51,969,500
アサツー ディ・ケイ	16,100	3,025.00	48,702,500
応用地質	10,000	1,340.00	13,400,000
船井総研ホールディングス	12,900	1,778.00	22,936,200
オオバ	11,200	441.00	4,939,200

ベネッセホールディングス	32,900	3,035.00	99,851,500	
イオンディライト	10,700	3,140.00	33,598,000	
ナック	8,600	908.00	7,808,800	
ニチイ学館	17,600	876.00	15,417,600	
ダイセキ	17,100	2,181.00	37,295,100	
合 計	140,101,300		200,450,853,880	

## (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

平成28年12月30日現在

資産総額	22,489,079,709円
負債総額	133,274,252円
純資産総額（ - ）	22,355,805,457円
発行済口数	10,151,162,327口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2023円
（1万口当たり純資産額）	（22,023円）

### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

#### イ 名義書換

該当事項はありません。

#### ロ 受益者名簿

作成しません。

#### ハ 受益者に対する特典

ありません。

#### ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

##### （イ）受益権の譲渡

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

##### （ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

#### ホ 受益権の再分割



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

へ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### イ 資本金の額および株式数

	平成28年12月30日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640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7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。

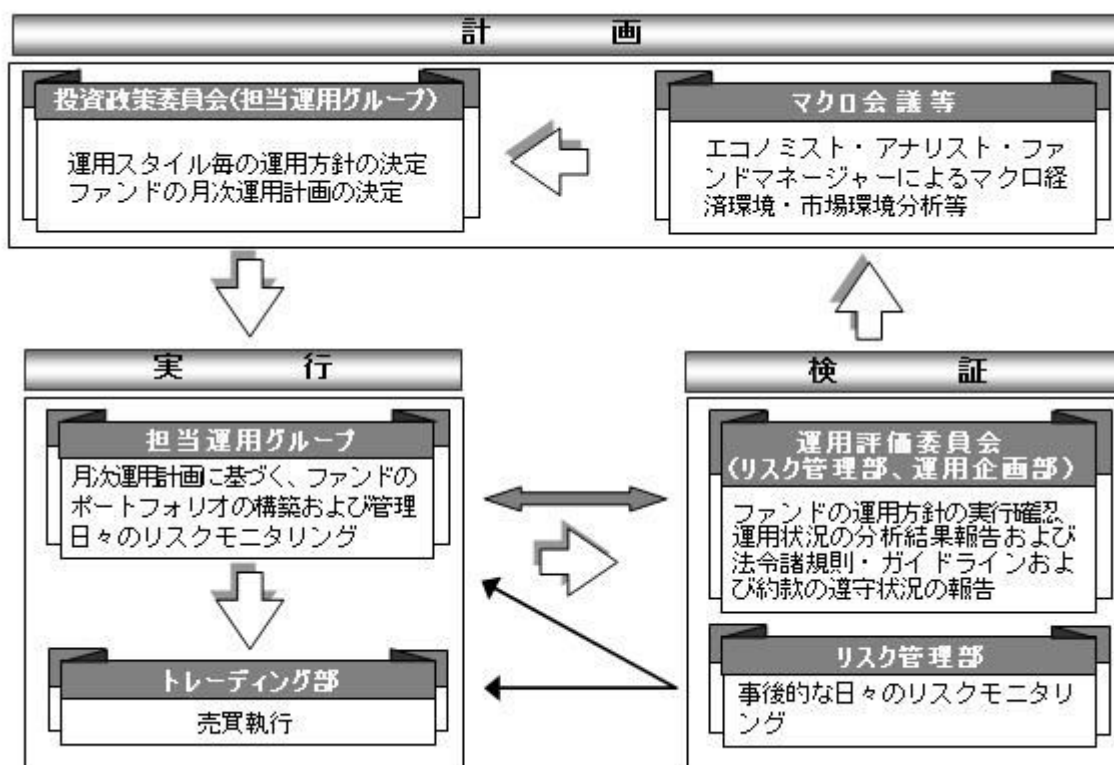
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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名選定します。

##### 二 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成28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。

（平成28年12月30日現在）

		本数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	65 ( 18 )	175,874 ( 68,107 )
	追加型	460 ( 193 )	5,140,978 ( 2,815,262 )
	計	525 ( 211 )	5,316,852 ( 2,883,369 )
公社債投資信託	単位型	83 ( 83 )	381,783 ( 381,783 )
	追加型	1 ( 0 )	29,689 ( 0 )
	計	84 ( 83 )	411,472 ( 381,783 )
合計		609 ( 294 )	5,728,324 ( 3,265,151 )

( )内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

## 3【委託会社等の経理状況】

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

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

2 当社は、第31期（平成27年4月1日から平成28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32期中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

### （1）【貸借対照表】

（単位：千円）

		前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金	2	25,021,336	10,857,507
顧客分別金信託		-	20,006

前払費用	291,119	324,934
未収入金	41,860	81,347
未収委託者報酬	4,897,032	5,418,116
未収運用受託報酬	1,000,744	1,635,461
未収投資助言報酬	455,390	382,911
未収収益	13,030	28,813
繰延税金資産	475,859	494,032
その他の流動資産	52,473	6,226
流動資産合計	32,248,847	19,249,357
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	120,234	154,246
器具備品	230,712	240,748
有形固定資産合計	350,947	394,995
無形固定資産		
ソフトウェア	497,668	449,034
ソフトウェア仮勘定	77,155	146,452
電話加入権	91	79
商標権	222	60
無形固定資産合計	575,137	595,627
投資その他の資産		
投資有価証券	7,151,933	13,115,106
関係会社株式	509,146	10,412,523
長期差入保証金	600,480	603,625
長期前払費用	36,031	32,533
会員権	17,299	17,299
繰延税金資産	665,425	750,481
投資その他の資産合計	8,980,317	24,931,569
固定資産合計	9,906,402	25,922,192
資産合計	42,155,249	45,171,549

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	-	0
その他の預り金	82,723	73,103
未払金		
未払収益分配金	711	154
未払償還金	143,201	141,808
未払手数料	2,338,432	2,479,778
その他未払金	1,075,587	58,453
未払費用	2,095,111	2,092,669
未払消費税等	478,421	317,444
未払法人税等	454,520	992,491
賞与引当金	906,623	982,654
その他の流動負債	808	-
流動負債合計	7,576,142	7,138,557
固定負債		
退職給付引当金	2,633,080	3,028,212
賞与引当金	-	51,310

その他の固定負債	-	693
固定負債合計	2,633,080	3,080,216
負債合計	10,209,222	10,218,774
純資産の部		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	18,861,359	21,984,811
利益剰余金合計	20,682,564	23,806,015
株主資本計	31,311,548	34,434,999
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	634,478	517,775
評価・換算差額等合計	634,478	517,775
純資産合計	31,946,027	34,952,774
負債・純資産合計	42,155,249	45,171,549

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益				
委託者報酬	30,094,858		32,339,255	
運用受託報酬	3,862,895		7,401,835	
投資助言報酬	2,106,161		1,909,892	
その他営業収益				
情報提供コンサルタント				
業務報酬	5,000		5,000	
投資法人運用受託報酬	27,345		8,546	
サービス支援手数料	18,274		74,038	
その他	52,255		55,319	
営業収益計	36,166,790		41,793,887	
営業費用				
支払手数料	15,123,724		16,006,652	
広告宣伝費	407,991		615,596	
公告費	4,737		4,507	
調査費				
調査費	1,319,743		1,624,477	
委託調査費	3,550,675		4,106,366	
営業雑経費				
通信費	38,911		43,662	
印刷費	294,002		399,236	

協会費		26,955	23,328
諸会費		18,577	22,650
情報機器関連費		2,403,857	2,557,200
販売促進費		28,281	31,271
その他		144,250	161,974
営業費用合計		23,361,707	25,596,925
一般管理費			
給料			
役員報酬		190,241	181,739
給料・手当		5,186,853	5,824,767
賞与		569,685	609,597
賞与引当金繰入額		906,623	1,033,964
交際費		22,609	26,912
寄付金		-	23
事務委託費		366,661	540,251
旅費交通費		226,254	277,212
租税公課		108,953	161,628
不動産賃借料		552,589	595,051
退職給付費用		387,799	701,070
固定資産減価償却費		287,833	334,024
諸経費		283,156	354,884
一般管理費合計		9,089,262	10,641,129
営業利益		3,715,820	5,555,832
営業外収益			
受取配当金		26,821	36,102
有価証券利息		1,187	-
受取利息	1	6,113	3,728
時効成立分配金・償還金		12	1,394
原稿・講演料		1,899	1,766
雑収入		7,324	19,472
営業外収益合計		43,357	62,465
営業外費用			
為替差損		14,361	51,385
営業外費用合計		14,361	51,385
経常利益		3,744,816	5,566,912
特別利益			
投資有価証券償還益		4,181	13,036
投資有価証券売却益		893,251	38,823
投資有価証券清算益		-	29,214
特別利益合計		897,432	81,075
特別損失			
固定資産除却損	2	1,076	5,300
投資有価証券償還損		-	2,313
投資有価証券売却損		1,091	8,184
その他の特別損失	3	973,862	-
特別損失合計		976,030	15,798
税引前当期純利益		3,666,218	5,632,188
法人税、住民税及び事業税		1,574,213	1,598,176
法人税等調整額		166,505	41,999
法人税等合計		1,740,718	1,556,177
当期純利益		1,925,499	4,076,011

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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			利益剰余金 合計	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
				配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292
会計方針の変更による 累積的影響額							439,043	439,043	439,043
会計方針の変更を反映した 当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,788,060	20,609,264	31,238,248
当期変動額									
剰余金の配当							1,852,200	1,852,200	1,852,200
当期純利益							1,925,499	1,925,499	1,925,499
株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	73,299	73,299	73,299
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	657,238	657,238	32,334,530
会計方針の変更による 累積的影響額			439,043
会計方針の変更を反映した 当期首残高	657,238	657,238	31,895,486
当期変動額			
剰余金の配当			1,852,200
当期純利益			1,925,499
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	22,759	22,759	22,759
当期変動額合計	22,759	22,759	50,540
当期末残高	634,478	634,478	31,946,027

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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			利益剰余金 合計	株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
				配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548
当期変動額									
剰余金の配当							952,560	952,560	952,560

当期純利益							4,076,011	4,076,011	4,076,011
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,123,451	3,123,451	3,123,451
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	634,478	634,478	31,946,027
当期変動額			
剰余金の配当			952,560
当期純利益			4,076,011
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	116,703	116,703	116,703
当期変動額合計	116,703	116,703	3,006,747
当期末残高	517,775	517,775	34,952,774

## [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) 満期保有目的の債券

償却原価法

## (2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

なお、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 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。



## (2)退職給付引当金

従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

## 退職給付見込額の期間帰属方法

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

## 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	258,412千円	281,421千円
器具備品	783,602千円	758,541千円

## 2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
現金及び預金	18,853,119千円	4,716,352千円

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。当事業年度末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28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

## 4 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	355,376千円	296,815千円

## (損益計算書関係)

1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
受取利息	2,463千円	1,423千円

## 2 固定資産除却損

	前事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)
器具備品	1,076千円	5,300千円

### 3 その他の特別損失

その他の特別損失は、中国において同国国家税務総局が平成26年11月17日付で公布した財税[2014]79号通達に基づき、当社が委託者として運用する証券投資信託に関し、適格国外機関投資家として課される平成21年11月17日から平成26年11月16日までに行われた中国A株投資のキャピタル・ゲインに対して遡及的に徴される源泉所得税等について納付すべきと見込まれる金額を計上したものであります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

#### 1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640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
平成26年 6月26日 定時株主総会	普通株式	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26年 6月27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  
平成27年 6月30日開催の第30回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の 総額(千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年 6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	952,560	54,000	平成27年 3月31日	平成27年 7月 1日

当事業年度(自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)

#### 1. 発行済株式数に関する事項

	当期首株式数	当期増加株式数	当期減少株式数	当期末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640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
平成27年 6月30日 定時株主総会	普通株式	952,560	54,000	平成27年 3月31日	平成27年 7月 1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  
平成28年 6月27日開催の第31回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の 総額(千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年 6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28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 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
1年以内	572,402	579,592
1年超	1,340,637	756,470
合計	1,913,040	1,336,063

(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及び50%出資した海外関連会社の株式であり、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、子会社株式及び関連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、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、定期的に取り締役会において報告し、投資家の資金性格、金額、および投資家数等の状況から検討した結果、目的が達成されたと判断した場合には速やかに処分することとしています。

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等に基づく価額のほか、これらの価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれています。当該価額の算定においては一定の前提条件を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることがあります。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません(注2)参照)。

前事業年度(平成27年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	25,021,336	25,021,336	-
(2)顧客分別金信託	-	-	-
(3)未収委託者報酬	4,897,032	4,897,032	-
(4)未収運用受託報酬	1,000,744	1,000,744	-
(5)未収投資助言報酬	455,390	455,390	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	7,131,075	7,131,075	-
(7)長期差入保証金	600,480	600,480	-
資産計	39,106,059	39,106,059	-
(1)顧客からの預り金	-	-	-
(2)未払手数料	2,338,432	2,338,432	-
負債計	2,338,432	2,338,432	-

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	10,857,507	10,857,507	-
(2)顧客分別金信託	20,006	20,006	-
(3)未収委託者報酬	5,418,116	5,418,116	-
(4)未収運用受託報酬	1,635,461	1,635,461	-
(5)未収投資助言報酬	382,911	382,911	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	13,114,808	13,114,808	-
(7)長期差入保証金	603,625	603,625	-
資産計	32,032,437	32,032,437	-
(1)顧客からの預り金	0	0	-
(2)未払手数料	2,479,778	2,479,778	-
負債計	2,479,778	2,479,778	-

(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、(2)未払手数料

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

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

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
その他有価証券		
非上場株式	298	298
投資証券	20,560	-
合計	20,858	298
子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	509,146	10,412,523
合計	509,146	10,412,523

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成27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	25,021,336	-	-	-
顧客分別金信託	-	-	-	-
未収委託者報酬	4,897,032	-	-	-
未収運用受託報酬	1,000,744	-	-	-
未収投資助言報酬	455,390	-	-	-
長期差入保証金	4,148	596,332	-	-
合計	31,378,651	596,332	-	-

当事業年度(平成28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	10,857,507	-	-	-
顧客分別金信託	20,006	-	-	-
未収委託者報酬	5,418,116	-	-	-
未収運用受託報酬	1,635,461	-	-	-
未収投資助言報酬	382,911	-	-	-
長期差入保証金	537,057	66,567	-	-
合計	18,851,060	66,567	-	-

(有価証券関係)

1.子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成27年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式509,146千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成28年3月31日)

子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 関係会社株式10,412,523千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2.その他有価証券

前事業年度(平成27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	5,826,531	4,894,554	931,977
小計	5,826,531	4,894,554	931,977
(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	1,304,543	1,312,300	7,756
小計	1,304,543	1,312,300	7,756
合計	7,131,075	6,206,854	924,220

(注)非上場株式等(貸借対照表計上額 20,858千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	7,852,587	7,058,420	794,166
小計	7,852,587	7,058,420	794,166
(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	5,262,221	5,310,100	47,878
小計	5,262,221	5,310,100	47,878
合計	13,114,808	12,368,520	746,288

(注)非上場株式等(貸借対照表計上額 298千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

### 3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成26年4月1日 至平成27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
3,892,685	893,251	1,091

当事業年度(自平成27年4月1日 至平成28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
327,278	38,823	8,184

### (退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

#### 2. 確定給付制度

##### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,802,340	2,633,080
会計方針の変更による累積的影響額	682,168	-
会計方針の変更を反映した期首残高	2,484,508	2,633,080
勤務費用	217,881	225,881
利息費用	18,161	19,247
数理計算上の差異の発生額	276	285,510

退職給付の支払額	87,196	135,507
退職給付債務の期末残高	2,633,080	3,028,212

## (2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,633,080	3,028,212
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	2,633,080	3,028,212

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：千円)	
	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
勤務費用	217,881	225,881
利息費用	18,161	19,247
数理計算上の差異の費用処理額	276	285,510
その他	152,031	170,430
確定給付制度に係る退職給付費用	387,799	701,070

(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になります。

## (4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
割引率	0.731%	0.000%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度105,357千円、当事業年度125,210千円であります。

## (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 of 主な原因別の内訳

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	299,729	303,247
調査費	77,863	74,734
未払金	321,602	44,028
未払事業税	49,504	67,598
その他	48,762	7,369
繰延税金資産小計	797,462	496,977
評価性引当額	321,602	2,945
繰延税金資産合計	475,859	494,032

## 固定の部

繰延税金資産		
退職給付引当金	849,431	927,238
特定外国子会社留保金額	211,024	205,413
ソフトウェア償却	62,560	35,707
賞与引当金	-	15,834
投資有価証券評価損	43,051	95
その他	6,291	5,971
繰延税金資産小計	1,172,360	1,190,261
評価性引当額	217,192	211,267
繰延税金資産合計	955,168	978,994
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	289,742	228,513
繰延税金負債合計	289,742	228,513
繰延税金資産の純額	1,141,285	1,244,513

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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
法定実効税率	35.6%	33.0%
(調整)		
評価性引当額の増減	9.6	5.5
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.1
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.5	0.0
住民税均等割等	0.2	0.1
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.7	1.3
所得税額控除による税額控除	1.3	1.5
その他	0.1	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	47.5	27.6

### 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産および繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.2%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.8%、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、30.6%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額（繰延税金負債の金額を控除した金額）は62,206千円減少し、法人税等調整額が74,445千円、その他有価証券評価差額金が12,239千円、それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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
外部顧客への売上高	30,094,858	3,862,895	2,106,161	102,874	36,166,790

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高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

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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
外部顧客への売上高	32,339,255	7,401,835	1,909,892	142,903	41,793,887

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高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

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）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
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) 直接 40 %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,527,962	未払手数料	289,954

(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

(1) 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. 子会社及び関連会社等

(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
子会社	ソーラーエナジー投資合同会社	東京都港区	20,000	投資運用業	(所有) 直接100 %	投資事業有限責任組合の運営及び管理	出資の引受	20,000	-	-
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	6,000,000 (シンガポールドル)	投資運用業	(所有) 直接50 %	投信の販売委託 役員の兼任	増資の引受	136,110	-	-

(注) 1. ソーラーエナジー投資合同会社の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。

2. UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.の増資の引受については、当社とUOBアセットマネジメント社がそれぞれ1,500,000(シンガポールドル)出資しました。

## 3. その他の関係会社の子会社等

(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
その他の関係会社の子会社	SMB C 日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,705,879	未払手数料	697,658

(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

(1) 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。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）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
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) 直接 40 %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,740,552	未払手数料	471,118

(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

(1) 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. 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
その他の関係会社の子会社	S M B C 日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	-	投信の販売委託 役員の兼任	子会社株式の取得	9,877,717	-	-
							委託販売手数料	5,483,224	未払手数料	912,899

(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

(1) 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。

### (1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	1,810,999.27円	1,981,449.82円
1株当たり当期純利益金額	109,155.30円	231,066.40円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,925,499	4,076,011
普通株主に帰属しない金額(千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額(千円)	1,925,499	4,076,011
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

### (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第32期中間会計期間 (平成28年9月30日)	
資産の部	
流動資産	
現金及び預金	8,667,657
顧客分別金信託	20,007

前払費用		306,916
未収委託者報酬		5,324,329
未収運用受託報酬		1,209,751
未収投資助言報酬		355,952
未収収益		22,873
繰延税金資産		493,517
その他		3,031
流動資産合計		16,404,036
固定資産		
有形固定資産	1	474,760
無形固定資産		615,866
投資その他の資産		
投資有価証券		13,931,717
関係会社株式		10,412,523
その他		1,631,772
投資その他の資産合計		25,976,013
固定資産合計		27,066,640
資産合計		43,470,677
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		98
その他の預り金		79,964
未払金		2,578,503
未払費用		1,682,389
未払法人税等		686,618
前受収益		414
賞与引当金		1,044,361
その他	2	125,455
流動負債合計		6,197,805
固定負債		
退職給付引当金		3,116,174
賞与引当金		30,000
その他		480
固定負債合計		3,146,654
負債合計		9,344,459
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
資本剰余金合計		8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		21,442,639
利益剰余金合計		23,263,844

株主資本合計	33,892,828
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	233,389
評価・換算差額等合計	233,389
純資産合計	34,126,217
負債純資産合計	43,470,677

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			15,185,419
運用受託報酬			2,663,858
投資助言報酬			869,344
その他の営業収益			63,406
営業収益計			18,782,028
営業費用			11,579,429
一般管理費	1		5,398,630
営業利益			1,803,967
営業外収益	2		116,871
営業外費用	3		3,173
経常利益			1,917,665
特別利益	4		179,785
特別損失	5		27,232
税引前中間純利益			2,070,218
法人税、住民税及び事業税			622,698
法人税等調整額			21,268
法人税等合計			601,429
中間純利益			1,468,788

## (3)中間株主資本等変動計算書

第32期中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

(単位：千円)

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金				利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	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	21,984,811	23,806,015	34,434,999
当中間期変動額									

剰余金の配当							2,010,960	2,010,960	2,010,960
中間純利益							1,468,788	1,468,788	1,468,788
株主資本以外の項目の当中間 期間変動額（純額）									
当中間期間変動額合計	-	-	-	-	-	-	542,171	542,171	542,171
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,442,639	23,263,844	33,892,828

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	517,775	517,775	34,952,774
当中間期間変動額			
剰余金の配当			2,010,960
中間純利益			1,468,788
株主資本以外の項目の当中間 期間変動額（純額）	284,385	284,385	284,385
当中間期間変動額合計	284,385	284,385	826,557
当中間期末残高	233,389	233,389	34,126,217

## （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

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

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）

時価のないもの

移動平均法による原価法

### 2．固定資産の減価償却の方法

#### (1)有形固定資産

定率法によっております。但し、建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

#### (2)無形固定資産

定額法によっております。

なお、ソフトウェア（自社利用分）については、社内における利用可能期間（5年）に基づく定額法によっております。

### 3．引当金の計上基準

#### (1)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。

## (2)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. 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)

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」(実務対応報告第32号 平成28年6月17日)を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

この結果、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ729千円増加しております。

### (追加情報)

「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)を当中間会計期間から適用しております。

### (中間貸借対照表関係)

第32期中間会計期間 (平成28年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,094,757千円
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 Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成35年6月までの賃借料総額248,465千円の支払保証を行っております。	

### (中間損益計算書関係)

第32期中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
--	--

1. 減価償却実施額	
有形固定資産	73,172千円
無形固定資産	112,944千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	106,640千円
雑収入	9,734千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	3,173千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	179,784千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
投資有価証券償還損	10,871千円
事務所移転費用	8,962千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第32期中間会計期間(自平成28年4月1日 至平成28年9月30日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間 末株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月27日 定時株主総会	普通株式	2,010,960	114,000	平成28年 3月31日	平成28年 6月28日

(リース取引関係)

第32期中間会計期間 (自平成28年4月1日 至平成28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	606,895千円
1年超	785,123千円
合計	1,392,018千円

(金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第32期中間会計期間(平成28年9月30日)

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

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



(1)現金及び預金	8,667,657	8,667,657	-
(2)顧客分別金信託	20,007	20,007	-
(3)未収委託者報酬	5,324,329	5,324,329	-
(4)未収運用受託報酬	1,209,751	1,209,751	-
(5)未収投資助言報酬	355,952	355,952	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	13,931,419	13,931,419	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	662,172	662,172	-
資産計	30,171,290	30,171,290	-
(1)顧客からの預り金	98	98	-
(2)未払金			
未払手数料	2,393,062	2,393,062	-
負債計	2,393,160	2,393,160	-

## (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、債券については取引金融機関から提示された価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

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

- (7)投資その他の資産

## 長期差入保証金

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

負債

- (1)顧客からの預り金、及び(2)未払金 未払手数料

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

## (注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
合計	298
子会社株式及び関連会社株式	
非上場株式	10,412,523
合計	10,412,523

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(6) その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式及び関連会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。

(有価証券関係)

第32期中間会計期間（平成28年9月30日）

1. 満期保有目的の債券

該当事項はありません。

2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 10,412,523千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

3. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	5,237,120	4,771,627	465,493
小計	5,237,120	4,771,627	465,493
(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	8,694,298	8,823,400	129,101
小計	8,694,298	8,823,400	129,101
合計	13,931,419	13,595,027	336,392

(注) 非上場株式等（中間貸借対照表計上額 298千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

(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。

(資産除去債務等)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第32期中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28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 売上高	15,185,419	2,663,858	869,344	63,406	18,782,028

## (2)地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が中間損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高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

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

## 3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (1株当たり情報)

第32期中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月 30日)	
1株当たり純資産額	1,934,592円84銭
1株当たり中間純利益	83,264円67銭
<p>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。</p>	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	34,126,217千円
普通株式に係る純資産額	34,126,217千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	1,468,788千円
普通株式に係る中間純利益	1,468,788千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

## 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

平成28年6月27日に開催された定時株主総会において、監査体制の見直しにより監査役の員数を2名増員し6名以内とする定款の変更が決議されました。

- 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（平成28年9月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### 〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円（平成28年9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。
損保ジャパン日本興亜 D C 証券株式会社	3,000百万円	
野村證券株式会社	10,000百万円	

株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595百万円	保険業法に基づき、損害保険業を営んでいます。
住友生命保険相互会社	639,000百万円	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。
三井生命保険株式会社	167,280百万円	営んでいます。

資本金の額は、平成28年9月末現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額は、平成28年9月末現在の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】

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3,528株（持株比率20.0%）保有しています。

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3,528株（持株比率20.0%）保有しています。

## 第3【その他】

- 目論見書の表紙等にロゴ・マーク、写真、イラスト、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態および属性、申込みにかかる事項、ユニバーサルデザインフォントマーク、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。
- 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」と称して使用することがあります。
- 目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- 目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
- 有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
- 目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
- 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。
- 有価証券届出書を個別に提出している複数のファンドの実質的な投資対象資産に共通性がある場合には、当該複数のファンドを一つの投資信託説明書（交付目論見書）で説明することがあります。このため、有価証券届出書に他のファンドの情報を合わせて記載することがあります。

9. 当ファンドとスイッチング対象ファンドにかかる投資信託説明書(交付目論見書)を一体のものとして使用することがあります。

**独立監査人の監査報告書**

平成28年 6月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽 一 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 池ヶ谷 正 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**監査意見**

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**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

平成29年1月10日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽 一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・日本株式インデックス年金ファンドの平成27年12月1日から平成28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。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・日本株式インデックス年金ファンドの平成28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すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以 上

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



**独立監査人の中間監査報告書**

平成28年11月24日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小澤陽一	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	池ヶ谷正	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成28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（平成28年4月1日から平成28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。

## 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。