

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成31年2月25日提出
【計算期間】	第16期(自 平成29年12月1日至 平成30年11月30日)
【ファンド名】	三井住友・日本株式インデックス年金ファンド
【発行者名】	三井住友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
【連絡場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【電話番号】	03-5405-0740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

## (イ) 当ファンドが該当する商品分類

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

## (ロ) 当ファンドが該当する属性区分

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

## 商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		資産複合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	対象インデックス
株式	年1回	グローバル		
一般				
大型株	年2回	日本		日経225
中小型株	年4回	北米		
債券			ファミリーファンド	
一般	年6回(隔月)	欧州		
公債				
社債	年12回(毎月)	アジア		
その他債券				
クレジット属性 ( )	日々	オセアニア		TOPIX
不動産投信	その他 ( )	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))		アフリカ		
資産複合 ( )		中近東(中東)		その他 ( )
資産配分固 定型		エマージング		
資産配分変 更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## (2) 【ファンドの沿革】

2003年2月21日

信託契約締結、設定、運用開始。

## (3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友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。

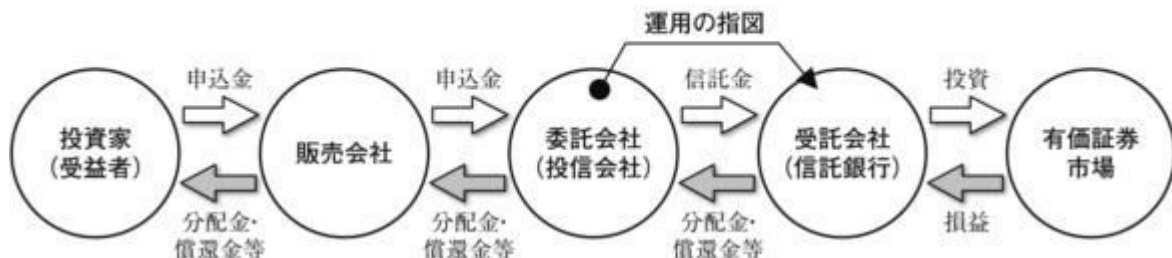
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

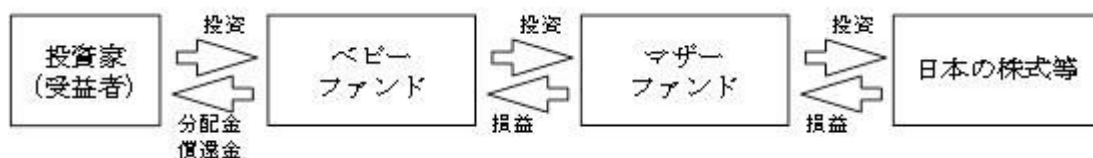
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

## 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（2018年12月28日現在）

(ロ) 会社の沿革

1985年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

1987年2月20日 証券投資顧問業の登録

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

## (八) 大株主の状況

(2018年12月28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	10,584,000	60.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪府中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	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	3,528,000	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、主として日本の株式に投資し、T O P I X（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ロ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、T O P I X（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため、日本の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- (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）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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



### TOPIXとは

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

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

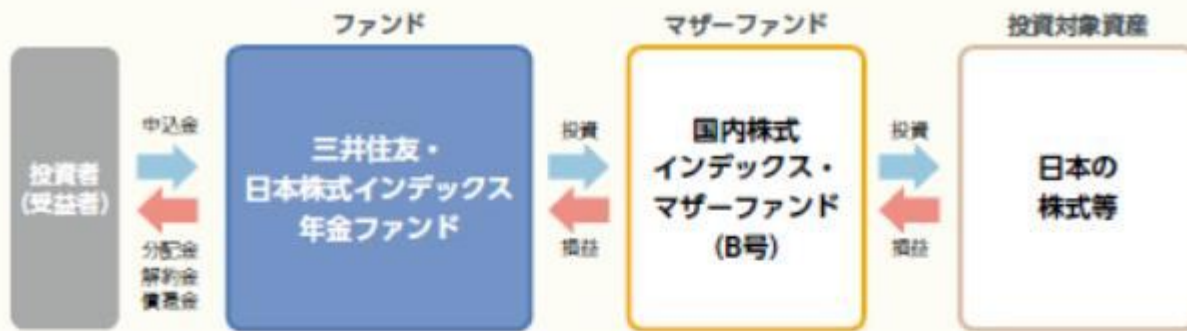
**2**

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。

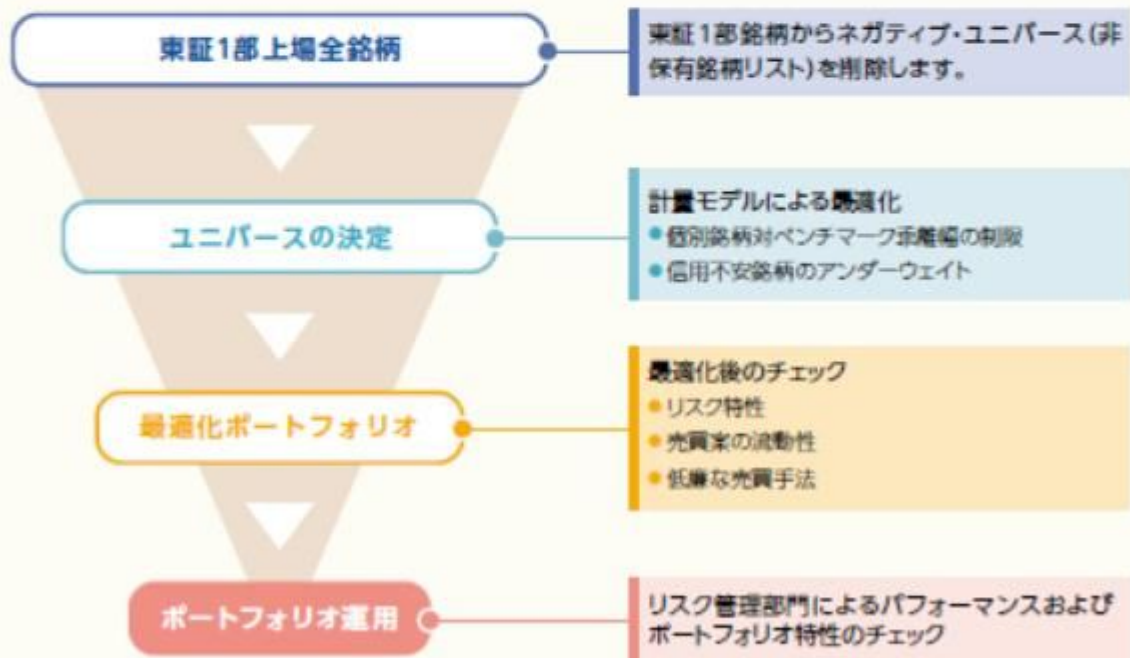
※資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## 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1998年12月末～2018年12月末。1998年12月末を100として数値化。

※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、実質的所有権、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。

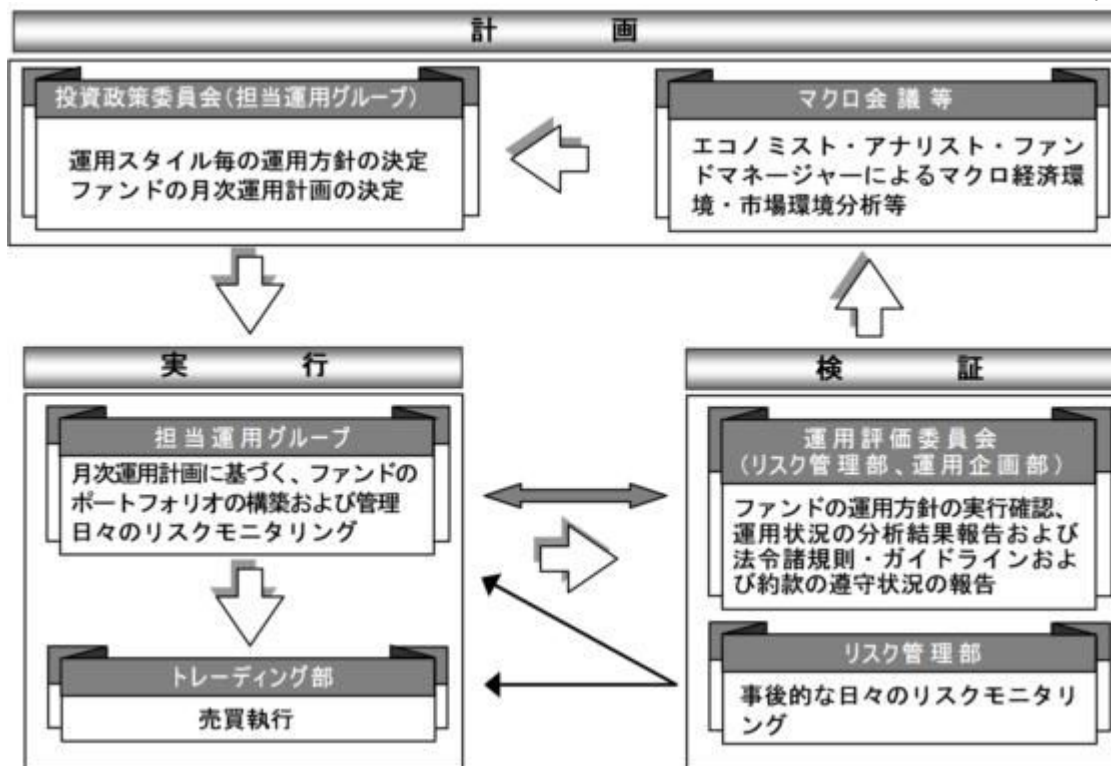
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

#### （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11名程度、運用企画部は10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）【配分方針】

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

- イ 分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- 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。）。

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

ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ 投資する株式の範囲

- (イ) 委託会社が投資することを指図する株式は、日本の取引所に上場している株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当により取得する株式については、この限りではありません。
- (ロ) 上記(イ)にかかわらず、上場予定の株式で目論見書等において上場されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図できるものとします。

ロ 先物取引等の運用指図、目的、範囲

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

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を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）  
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。
- ハ 信用リスク集中回避のための投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2）  
委託会社は、運用財産に関し、信用リスク（保有する有価証券その他の資産について取引の相手方の債務不履行その他の理由により発生し得る危険をいいます。）を適正に管理する方法としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法に反することとなる取引を行うことを受託会社に指図しないものとします。

（参考情報：国内株式インデックス・マザーファンド（B号）の投資方針等）

#### （1）投資方針等

- イ 基本方針  
主として日本の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ロ 投資態度
  - （イ）主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
  - （ロ）株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
  - （ハ）株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

#### （2）投資対象

- イ 投資対象とする資産の種類  
前記「2 投資方針（2）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。
- ロ 投資対象とする有価証券  
前記「2 投資方針（2）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第1号から第7号に同じです。
- ハ 投資対象とする金融商品  
前記「2 投資方針（2）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

### （３）投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

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

#### （ニ）指数の動きと連動しない要因

当ファンドは、TOPIX（東証株価指数、配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、有価証券売買時のコストおよび信託報酬その他のファンド運営にかかる費用、追加設定・解約に伴う組入有価証券の売買のタイミング差、インデックス構

成銘柄と組入有価証券との誤差の影響、株価指数先物とインデックスとの動きの不一致等から、上記インデックスの動きに連動しないことがあります。

(ホ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、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。

ロ 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、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。

## 各資産クラスの指数

日本株	TOPIX(配当込み) 株式会社東京証券取引所が算出、公表する指数で、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象としています。
先進国株	MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、日本を除く世界の主要先進国の株式を対象としています。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(グロス配当込み、円ベース) MSCI Inc.が開発した指数で、新興国の株式を対象としています。
日本国債	NOMURA-BPI(国債) 野村證券株式会社が公表する指数で、国内で発行された公募固定利付国債を対象としています。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース) FTSE Fixed Income LLCにより運営されている指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド(円ベース) J.P. Morganが算出、公表する指数で、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象としています。

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。  
※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。また、上記各指数の発行者および許諾者は、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

## 4 【手数料等及び税金】

### (1) 【申込手数料】

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。

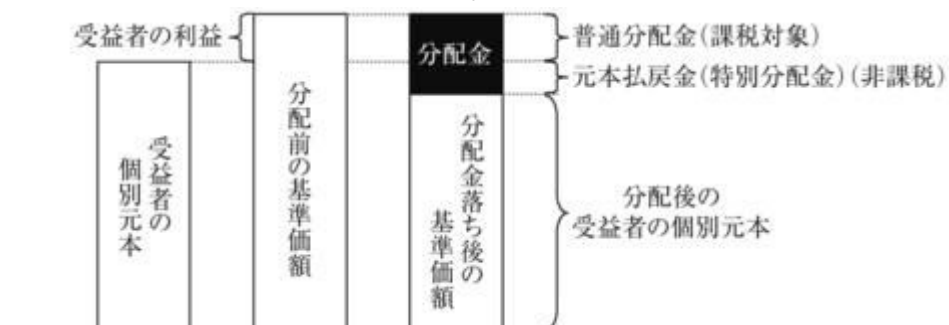
#### ハ 収益分配金の課税について

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、2018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

2018年12月28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	24,141,098,407	100.02

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,252,158	0.02
合計(純資産総額)		24,135,846,249	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

2018年12月28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)	10,369,887,632	2.5918	26,876,726,906	2.3280	24,141,098,407	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

2018年12月28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7期 (2009年11月30日)	6,958,904,410	6,958,904,410	10,720	10,720
第8期 (2010年11月30日)	8,594,601,878	8,594,601,878	11,172	11,172
第9期 (2011年11月30日)	8,322,277,845	8,322,277,845	9,656	9,656
第10期 (2012年11月30日)	9,844,615,684	9,844,615,684	10,577	10,577
第11期 (2013年12月 2日)	16,669,083,903	16,669,083,903	17,321	17,321
第12期 (2014年12月 1日)	19,103,300,879	19,103,300,879	19,898	19,898
第13期 (2015年11月30日)	21,767,535,950	21,767,535,950	22,472	22,472
第14期 (2016年11月30日)	22,218,652,970	22,218,652,970	21,289	21,289
第15期 (2017年11月30日)	26,401,156,315	26,401,156,315	26,454	26,454
第16期 (2018年11月30日)	26,819,215,931	26,819,215,931	25,113	25,113
2017年12月末日	26,881,976,409		26,857	
2018年 1月末日	27,578,103,507		27,135	
2月末日	26,685,165,863		26,125	
3月末日	26,366,527,095		25,591	
4月末日	27,396,418,787		26,502	
5月末日	26,872,507,239		26,064	
6月末日	26,851,765,151		25,845	
7月末日	27,275,979,938		26,175	
8月末日	27,001,972,883		25,907	
9月末日	28,481,914,409		27,374	
10月末日	26,159,360,654		24,786	
11月末日	26,819,215,931		25,113	
12月末日	24,135,846,249		22,536	

## 【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7期	2008年12月 2日～2009年11月30日	0
第8期	2009年12月 1日～2010年11月30日	0
第9期	2010年12月 1日～2011年11月30日	0
第10期	2011年12月 1日～2012年11月30日	0
第11期	2012年12月 1日～2013年12月 2日	0
第12期	2013年12月 3日～2014年12月 1日	0
第13期	2014年12月 2日～2015年11月30日	0
第14期	2015年12月 1日～2016年11月30日	0
第15期	2016年12月 1日～2017年11月30日	0
第16期	2017年12月 1日～2018年11月30日	0

## 【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
第15期	24.3
第16期	5.1

（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
第15期	2,900,377,274	3,357,020,358
第16期	2,775,404,878	2,076,030,207

（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）

2018年12月28日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	155,308,335,090	98.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,664,872,693	1.69
合計(純資産総額)		157,973,207,783	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	2,897,390,000	1.83
合計	買建		2,897,390,000	1.83

## (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)

2018年12月28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	818,700	6,798.92	5,566,277,900	6,406.00	5,244,592,200	3.32
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	5,047,000	623.11	3,144,859,000	537.90	2,714,781,300	1.72
日本	株式	ソニー	電気機器	492,600	5,928.57	2,920,415,200	5,326.00	2,623,587,600	1.66
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	493,100	4,674.63	2,305,060,400	4,482.00	2,210,074,200	1.40
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	301,400	9,494.69	2,861,702,200	7,305.00	2,201,727,000	1.39
日本	株式	キーエンス	電気機器	36,100	61,505.65	2,220,354,200	55,680.00	2,010,048,000	1.27
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	510,700	4,173.65	2,131,485,600	3,645.00	1,861,501,500	1.18
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	619,600	3,196.33	1,980,448,800	2,894.50	1,793,432,200	1.14
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,844,000	187.98	1,850,496,800	170.30	1,676,433,200	1.06
日本	株式	KDDI	情報・通信業	635,300	2,662.99	1,691,802,400	2,624.00	1,667,027,200	1.06
日本	株式	三菱商事	卸売業	507,700	3,061.76	1,554,458,300	3,020.00	1,533,254,000	0.97



日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	65,800	23,313.56	1,534,032,800	23,165.00	1,524,257,000	0.96
日本	株式	花王	化学	178,400	8,356.06	1,490,722,800	8,154.00	1,454,673,600	0.92
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	303,200	4,938.43	1,497,332,800	4,783.00	1,450,205,600	0.92
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	262,600	5,597.49	1,469,902,600	5,236.00	1,374,973,600	0.87
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	503,000	3,116.58	1,567,642,000	2,662.50	1,339,237,500	0.85
日本	株式	任天堂	その他製品	45,200	34,522.85	1,560,433,000	29,285.00	1,323,682,000	0.84
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	517,400	2,625.21	1,358,286,700	2,472.50	1,279,271,500	0.81
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	130,600	10,310.39	1,346,537,900	9,711.00	1,268,256,600	0.80
日本	株式	キヤノン	電気機器	395,100	3,216.70	1,270,921,100	3,001.00	1,185,695,100	0.75
日本	株式	ダイキン工業	機械	100,200	12,594.19	1,261,938,700	11,695.00	1,171,839,000	0.74
日本	株式	ファナック	電気機器	69,800	19,331.56	1,349,343,000	16,670.00	1,163,566,000	0.74
日本	株式	村田製作所	電気機器	77,100	17,287.83	1,332,892,100	14,955.00	1,153,030,500	0.73
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	425,800	2,820.88	1,201,131,600	2,616.50	1,114,105,700	0.71
日本	株式	日本電産	電気機器	88,400	15,075.07	1,332,636,400	12,475.00	1,102,790,000	0.70
日本	株式	信越化学工業	化学	126,800	10,107.31	1,281,608,000	8,536.00	1,082,364,800	0.69
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	290,100	4,247.11	1,232,089,300	3,705.00	1,074,820,500	0.68
日本	株式	三井物産	卸売業	596,300	1,772.81	1,057,131,950	1,690.50	1,008,045,150	0.64
日本	株式	資生堂	化学	146,000	7,218.26	1,053,866,800	6,892.00	1,006,232,000	0.64
日本	株式	HOYA	精密機器	147,900	6,895.30	1,019,814,900	6,615.00	978,358,500	0.62

## □ 種類別・業種別の投資比率

2018年12月28日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.12
		鉱業	0.28
		建設業	3.05
		食料品	4.46
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.28
		化学	7.37
		医薬品	4.82
		石油・石炭製品	0.70
		ゴム製品	0.82
		ガラス・土石製品	0.88
		鉄鋼	0.98
		非鉄金属	0.78
		金属製品	0.58
		機械	4.75
		電気機器	12.47
輸送用機器	8.17		
精密機器	1.87		

	その他製品	2.05
	電気・ガス業	1.99
	陸運業	4.86
	海運業	0.16
	空運業	0.63
	倉庫・運輸関連業	0.19
	情報・通信業	7.38
	卸売業	5.02
	小売業	5.18
	銀行業	6.40
	証券、商品先物取引業	0.87
	保険業	2.31
	その他金融業	1.15
	不動産業	2.37
	サービス業	4.72
合計		98.31

#### 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）

2018年12月28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	194	日本円	2,899,614,520	2,897,390,000	1.83

（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:2018年12月28日

\*ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

\*委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 基準価額・純資産の推移



\*基準価額は、1万口当たり、徴託税控除後です。

## 分配の推移

決算期	分配金
2018年11月	0円
2017年11月	0円
2016年11月	0円
2015年11月	0円
2014年12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。  
\*最近5計算期間を記載しています。

## 主要な資産の状況

### ■三井住友・日本株式インデックス年金ファンド

#### 資産別構成

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

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

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

### ■国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

#### 資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
株式	日本	98.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.69
合計(純資産総額)		100.00

\*株価急激な先物取引の買建て 1.83%

#### 主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	業種	比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	3.32
日本	株式	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	1.72
日本	株式	ソニー	電気機器	1.66
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.40
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.39
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.27
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.18
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1.14
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.06
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1.06

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

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

## 年間収益率の推移(暦年ベース)



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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### イ 申込方法

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

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

#### ハ 申込手数料

無手数料です。

#### ニ 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	<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。

#### 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。）。

##### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

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

委託会社に対する照会は下記においてできます。

照会先の名称	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。

#### (2)【保管】

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

#### (3)【信託期間】

2003年2月21日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

#### （４）【計算期間】

毎年12月1日から翌年11月30日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### （５）【その他】

##### イ 信託の終了

##### （イ）信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、受益権口数が30億口を下回ったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 上記bの公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記cの一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は、当ファンドの信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- f. 上記c～eまでの取扱いは、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記cの一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

##### （ロ）信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

##### （ハ）委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

##### （ニ）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

##### ロ 収益分配金、償還金の支払い

##### （イ）収益分配金

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

#### (ロ) 償還金

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

### 八 信託約款の変更

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- (ハ) 上記(ロ)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、(イ)の信託約款の変更をしません。
- (ホ) 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

### 二 反対者の買取請求権

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

### ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、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。

### へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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



## ト 公告

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

<http://www.smam-jp.com>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書（全体版）および運用報告書（全体版）の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。

交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書（全体版）は、委託会社のホームページで閲覧できます。

## 4【受益者の権利等】

委託会社の指図に基づく行為によりファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。当ファンドの受益権は、信託の日時を異にすることにより差異が生ずることはありません。

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

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

### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

### ハ 一部解約実行請求権

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

### 二 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に関する異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となるときは、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16期（平成29年12月1日から平成30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15期 (平成29年11月30日現在)	第16期 (平成30年11月30日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
金銭信託	1,322,133	21,117,220
コール・ローン	31,132,648	3,857,937
親投資信託受益証券	26,434,336,253	26,855,731,271
未収入金	-	12,669,495
<b>流動資産合計</b>	<b>26,466,791,034</b>	<b>26,893,375,923</b>
<b>資産合計</b>	<b>26,466,791,034</b>	<b>26,893,375,923</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	32,450,412	37,637,124
未払受託者報酬	5,307,140	5,841,366
未払委託者報酬	27,862,395	30,667,134
未払利息	91	11
その他未払費用	14,681	14,357
<b>流動負債合計</b>	<b>65,634,719</b>	<b>74,159,992</b>
<b>負債合計</b>	<b>65,634,719</b>	<b>74,159,992</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	9,979,860,321	10,679,234,992
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	16,421,295,994	16,139,980,939
<b>元本等合計</b>	<b>26,401,156,315</b>	<b>26,819,215,931</b>
<b>純資産合計</b>	<b>26,401,156,315</b>	<b>26,819,215,931</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>26,466,791,034</b>	<b>26,893,375,923</b>

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第15期		第16期	
	自 至	平成28年12月1日 平成29年11月30日	自 至	平成29年12月1日 平成30年11月30日
営業収益				
有価証券売買等損益		5,276,873,869		1,291,501,626
営業収益合計		5,276,873,869		1,291,501,626
営業費用				
支払利息		28,382		17,502
受託者報酬		10,156,303		11,590,215
委託者報酬		53,320,438		60,848,547
その他費用		31,723		36,638
営業費用合計		63,536,846		72,492,902
営業利益又は営業損失( )		5,213,337,023		1,363,994,528
経常利益又は経常損失( )		5,213,337,023		1,363,994,528
当期純利益又は当期純損失( )		5,213,337,023		1,363,994,528
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( )		626,986,677		45,255,977
期首剰余金又は期首欠損金( )		11,782,149,565		16,421,295,994
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,898,844,116		4,452,785,121
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,898,844,116		4,452,785,121
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,846,048,033		3,415,361,625
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,846,048,033		3,415,361,625
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金( )		16,421,295,994		16,139,980,939

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第16期
	自 平成29年12月 1日 至 平成30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15期	第16期
	( 平成29年11月30日現在 )	( 平成30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	9,979,860,321口	10,679,234,992口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.6454円 (10,000口当たりの純資産額 26,454円)	1口当たり純資産額 2.5113円 (10,000口当たりの純資産額 25,113円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項目	第15期	第16期
	自 平成28年12月 1日 至 平成29年11月30日	自 平成29年12月 1日 至 平成30年11月30日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(479,450,941円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(3,623,567,822円)、収益調整金(10,164,430,704円)、および分配準備積立金(3,160,824,910円)より、分配対象収益は17,428,274,377円(1万口当たり17,463.42円)ですが、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(528,680,154円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(12,722,939,879円)、および分配準備積立金(5,933,598,495円)より、分配対象収益は19,185,218,528円(1万口当たり17,964.95円)ですが、分配を行っておりません。</p>

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第16期
	自 平成29年12月 1日 至 平成30年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>
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16期 自 平成29年12月 1日 至 平成30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16期 (平成30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（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15期（自 平成28年12月 1日 至 平成29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	5,029,611,430円
合計	5,029,611,430円

第16期（自 平成29年12月 1日 至 平成30年11月30日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,266,320,676円
合計	1,266,320,676円

## （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16期 自 平成29年12月 1日 至 平成30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15期 （平成29年11月30日現在）	第16期 （平成30年11月30日現在）
期首元本額	10,436,503,405円	9,979,860,321円
期中追加設定元本額	2,900,377,274円	2,775,404,878円
期中一部解約元本額	3,357,020,358円	2,076,030,207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)	10,354,216,475	26,855,731,271	
合計		10,354,216,475	26,855,731,271	

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29年11月30日現在)	(平成30年11月30日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	100,867,335	3,283,915,460
コール・ローン	2,375,152,044	599,943,591
株式	190,034,814,150	168,579,248,010
派生商品評価勘定	22,657,360	134,774,480
未収入金	189,200	80,584,796
未収配当金	1,103,825,887	1,095,772,321
差入委託証拠金	17,655,000	26,595,000
流動資産合計	193,655,160,976	173,800,833,658
資産合計	193,655,160,976	173,800,833,658
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	834,320	2,694,840
前受金	21,890,000	132,395,000
未払金	-	1,592,960
未払解約金	607,066,570	116,111,681
未払利息	6,962	1,758
その他未払費用	58,774	263,041
流動負債合計	629,856,626	253,059,280
負債合計	629,856,626	253,059,280
純資産の部		
元本等		

	（平成29年11月30日現在）	（平成30年11月30日現在）
元本	70,854,907,568	66,912,228,971
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	122,170,396,782	106,635,545,407
元本等合計	193,025,304,350	173,547,774,378
純資産合計	193,025,304,350	173,547,774,378
負債純資産合計	193,655,160,976	173,800,833,658

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自平成29年12月1日 至平成30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29年11月30日現在）	（平成30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 3,522,000,000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 2,721,200,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	70,854,907,568口	66,912,228,971口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.7242円 (10,000口当たりの純資産額 27,242円)	1口当たり純資産額 2.5937円 (10,000口当たりの純資産額 25,937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29年12月 1日 至 平成30年11月30日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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30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29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	2,781,496,960	-	2,803,320,000	21,823,040
	東証株価指数先物	2,781,496,960	-	2,803,320,000	21,823,040
合計		2,781,496,960	-	2,803,320,000	21,823,040

（平成30年11月30日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	4,738,480,360	-	4,870,560,000	132,079,640
	東証株価指数先物	4,738,480,360	-	4,870,560,000	132,079,640
合計		4,738,480,360	-	4,870,560,000	132,079,640

（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29年12月 1日 至 平成30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29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	93,628,160,347円
同期中における追加設定元本額	15,411,032,124円
同期中における一部解約元本額	38,184,284,903円
平成29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	9,703,522,595円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	601,574,522円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,941,578,441円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,159,565,951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)	146,867,685円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,072,256円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	21,737,956円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	56,441,195円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	61,403,830円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	34,583,133円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	93,675,761円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,258,548,287円
三井住友・DCつみたてN I S A ・日本株インデックスファンド	3,512,215,055円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	548,727,701円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	870,164,102円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	880,688,782円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,694,364円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	77,419円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	621,209円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,792,550円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	9,419,639円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	12,475,217円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	892,449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)	8,293,658,882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 >	35,192,008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 >	3,593,405,593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 >	4,224,570,178円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	2,707,437,600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 >	9,990,760,791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 >	59,777,193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 >	243,672,433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 >	1,569,299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 >	1,083,328,933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 >	64,742,845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 >	405,784,462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 >	1,167,685,548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 >	1,475,624,119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 >	3,514,768,578円
S M A M ・ バランスV A 株4 0 T < 適格機関投資家限定 >	88,244,909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)	1,527,265,717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 >	75,601,383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 >	118,198,824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)	1,778,332,732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 >	115,908,138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 >	52,998,705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 >	23,441,238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 >	229,793,791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 >	412,464,457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 >	174,873,606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 >	123,105,106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 >	61,153,864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 >	11,244,478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 >	80,230,517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 >	1,044,312,649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 )	209,546,573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 >	21,310,839円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型) V A < 適格機関投資家限定 >	1,910,689,341円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型) V A < 適格機関投資家限定 >	292,412,489円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A < 適格機関投資家限定 >	1,772,189,307円
S M A M ・ 世界バランスファンドV A 2 < 適格機関投資家限定 >	477,821,118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 >	300,693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 >	192,135,872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 >	92,009,873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 >	179,002,788円
合計	70,854,907,568円

(平成30年11月30日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	70,854,907,568円
同期中における追加設定元本額	13,339,206,384円
同期中における一部解約元本額	17,281,884,981円
平成30年11月30日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	10,354,216,475円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	768,941,629円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,698,515,899円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,692,088,576円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	180,714,188円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,445,740円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	24,782,474円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	62,529,551円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	87,629,751円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	51,789,894円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	131,284,628円
国内株式指数ファンド(T O P I X)	1,987,526,237円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 日本株インデックスファンド	7,498,073,954円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	443,898,286円

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	618,202,967円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	611,775,561円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	8,569,755円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	9,514,881円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	10,918,100円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	39,419,537円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	28,365,827円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	63,515,584円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	5,621,357円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	5,957,306,958円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	24,723,073円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型〈適格機関投資家限定〉	514,312,458円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	3,486,172,970円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	2,450,832,018円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	9,016,678,236円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	57,327,222円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	223,654,156円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	758,842円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	978,965,161円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型〈適格機関投資家限定〉	55,007,822円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	384,921,677円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	1,118,064,318円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	928,739,841円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	3,098,232,570円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,510,156円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,207,656,106円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	64,109,227円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	85,263,426円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,640,032,255円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	106,297,419円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	48,499,056円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	22,363,154円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	211,902,924円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	386,107,457円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	169,452,674円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	120,236,114円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	60,898,000円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	11,117,259円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉	78,033,493円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉	973,799,546円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	202,412,662円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2〈適格機関投資家専用〉	19,535,802円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA〈適格機関投資家限定〉	1,677,781,097円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA〈適格機関投資家限定〉	232,095,874円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	1,575,906,619円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	133,573,058円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド〈適格機関投資家限定〉	8,319,114円

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 >	73,059,305円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	35,005,032円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	86,203,195円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	20,774円
合計	66,912,228,971円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,500	3,225.00	11,287,500	
日本水産	96,800	686.00	66,404,800	
マルハニチロ	14,000	4,105.00	57,470,000	
カネコ種苗	4,000	1,437.00	5,748,000	
サカタのタネ	11,500	3,895.00	44,792,500	
ホクト	7,900	2,019.00	15,950,100	
日鉄鉱業	2,400	5,560.00	13,344,000	
三井松島ホールディングス	4,900	1,612.00	7,898,800	
国際石油開発帝石	389,500	1,205.00	469,347,500	
石油資源開発	13,700	2,354.00	32,249,800	
K & O エナジーグループ	5,100	1,636.00	8,343,600	
ヒノキヤグループ	2,600	2,113.00	5,493,800	
ショーボンドホールディングス	7,500	8,700.00	65,250,000	
ミライト・ホールディングス	24,100	1,664.00	40,102,400	
タマホーム	7,200	1,111.00	7,999,200	
T A T E R U	12,500	394.00	4,925,000	
スペースバリューホールディングス	12,800	1,046.00	13,388,800	
安藤・間	61,700	686.00	42,326,200	
東急建設	28,400	1,145.00	32,518,000	
コムシスホールディングス	34,300	2,930.00	100,499,000	
ミサワホーム	9,300	831.00	7,728,300	

ピーアールホールディングス	10,500	397.00	4,168,500	
高松コンストラクショングループ	6,000	2,899.00	17,394,000	
東建コーポレーション	2,900	7,780.00	22,562,000	
大成建設	79,500	4,990.00	396,705,000	
大林組	239,000	1,132.00	270,548,000	
清水建設	243,600	970.00	236,292,000	
飛島建設	7,500	1,560.00	11,700,000	
長谷工コーポレーション	99,800	1,374.00	137,125,200	
松井建設	10,800	853.00	9,212,400	
銭高組	1,300	5,500.00	7,150,000	
鹿島建設	187,000	1,571.00	293,777,000	
不動テトラ	7,000	1,952.00	13,664,000	
大末建設	5,400	1,190.00	6,426,000	
鉄建建設	5,100	3,020.00	15,402,000	
西松建設	17,800	2,618.00	46,600,400	
三井住友建設	59,300	705.00	41,806,500	
大豊建設	5,500	3,775.00	20,762,500	
前田建設工業	57,800	1,192.00	68,897,600	
奥村組	13,600	3,785.00	51,476,000	
東鉄工業	9,400	3,340.00	31,396,000	
浅沼組	3,200	3,475.00	11,120,000	
戸田建設	93,400	764.00	71,357,600	
熊谷組	11,400	3,595.00	40,983,000	
北野建設	2,200	4,075.00	8,965,000	
矢作建設工業	13,100	764.00	10,008,400	
ピーエス三菱	11,100	711.00	7,892,100	
日本ハウスホールディングス	18,300	504.00	9,223,200	
大東建託	28,600	14,830.00	424,138,000	
新日本建設	10,200	1,210.00	12,342,000	
N I P P O	20,600	1,935.00	39,861,000	
東亜道路工業	2,200	3,250.00	7,150,000	
前田道路	25,200	2,230.00	56,196,000	
日本道路	2,300	6,170.00	14,191,000	
東亜建設工業	7,500	1,576.00	11,820,000	
若築建設	5,800	1,723.00	9,993,400	
東洋建設	32,300	423.00	13,662,900	

五洋建設	96,400	716.00	69,022,400
世紀東急工業	14,800	674.00	9,975,200
福田組	2,800	5,410.00	15,148,000
住友林業	56,500	1,675.00	94,637,500
巴コーポレーション	16,000	451.00	7,216,000
大和ハウス工業	221,400	3,575.00	791,505,000
ライト工業	15,600	1,545.00	24,102,000
積水ハウス	245,500	1,711.00	420,050,500
日特建設	8,700	700.00	6,090,000
ユアテック	13,300	936.00	12,448,800
中電工	9,600	2,524.00	24,230,400
関電工	35,000	1,178.00	41,230,000
きんでん	52,800	1,966.00	103,804,800
東京エネシス	9,100	965.00	8,781,500
トーエネック	2,800	3,140.00	8,792,000
住友電設	6,200	2,079.00	12,889,800
日本電設工業	13,200	2,482.00	32,762,400
協和エクシオ	31,300	2,860.00	89,518,000
新日本空調	7,500	2,063.00	15,472,500
九電工	15,800	4,415.00	69,757,000
三機工業	18,200	1,221.00	22,222,200
日揮	69,000	1,658.00	114,402,000
中外炉工業	3,100	2,468.00	7,650,800
ヤマト	10,000	636.00	6,360,000
太平電業	5,500	2,790.00	15,345,000
高砂熱学工業	19,700	2,037.00	40,128,900
朝日工業社	2,300	3,330.00	7,659,000
明星工業	14,800	845.00	12,506,000
大気社	10,900	3,190.00	34,771,000
ダイダン	5,600	2,553.00	14,296,800
日比谷総合設備	7,900	1,926.00	15,215,400
東芝プラントシステム	17,000	2,483.00	42,211,000
OSJBホールディングス	40,700	338.00	13,756,600
新興プランテック	15,100	1,154.00	17,425,400
日本製粉	22,600	1,937.00	43,776,200
日清製粉グループ本社	79,900	2,385.00	190,561,500

日東富士製粉	600	5,620.00	3,372,000
昭和産業	6,300	2,837.00	17,873,100
鳥越製粉	9,100	948.00	8,626,800
中部飼料	9,200	1,405.00	12,926,000
フィード・ワン	52,400	210.00	11,004,000
日本甜菜製糖	5,300	1,967.00	10,425,100
三井製糖	5,500	3,020.00	16,610,000
日新製糖	3,800	2,385.00	9,063,000
森永製菓	18,100	4,990.00	90,319,000
中村屋	2,500	4,515.00	11,287,500
江崎グリコ	21,500	5,530.00	118,895,000
名糖産業	5,400	1,475.00	7,965,000
井村屋グループ	3,500	3,115.00	10,902,500
不二家	4,500	2,514.00	11,313,000
山崎製パン	58,500	2,383.00	139,405,500
モロゾフ	1,600	5,470.00	8,752,000
亀田製菓	4,500	5,360.00	24,120,000
寿スピリッツ	7,500	4,850.00	36,375,000
カルビー	32,700	3,760.00	122,952,000
森永乳業	14,500	3,325.00	48,212,500
六甲バター	5,500	2,383.00	13,106,500
ヤクルト本社	53,000	8,550.00	453,150,000
明治ホールディングス	50,500	8,930.00	450,965,000
雪印メグミルク	17,300	3,160.00	54,668,000
プリマハム	9,900	2,156.00	21,344,400
日本ハム	30,700	4,210.00	129,247,000
丸大食品	8,000	2,021.00	16,168,000
S Foods	6,400	4,905.00	31,392,000
伊藤ハム米久ホールディングス	40,600	755.00	30,653,000
サッポロホールディングス	26,300	2,585.00	67,985,500
アサヒグループホールディングス	150,100	4,754.00	713,575,400
キリンホールディングス	324,100	2,665.00	863,726,500
宝ホールディングス	53,900	1,447.00	77,993,300
オエノンホールディングス	24,800	386.00	9,572,800
養命酒製造	3,200	2,423.00	7,753,600

コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	54,700	3,250.00	177,775,000
サントリー食品インターナショナル	47,500	4,760.00	226,100,000
ダイドーグループホールディングス	3,900	6,180.00	24,102,000
伊藤園	23,700	5,210.00	123,477,000
キーコーヒー	6,900	2,149.00	14,828,100
日清オイリオグループ	9,000	3,520.00	31,680,000
不二製油グループ本社	17,500	3,630.00	63,525,000
かどや製油	1,000	5,840.00	5,840,000
J - オイルミルズ	3,600	4,050.00	14,580,000
キッコーマン	47,100	6,620.00	311,802,000
味の素	158,300	1,962.50	310,663,750
キュービー	39,900	2,756.00	109,964,400
ハウス食品グループ本社	27,100	4,025.00	109,077,500
カゴメ	28,600	3,315.00	94,809,000
焼津水産化学工業	7,700	1,092.00	8,408,400
アリアケジャパン	6,400	9,810.00	62,784,000
ニチレイ	37,100	3,205.00	118,905,500
東洋水産	36,600	3,890.00	142,374,000
イトアンド	3,600	1,771.00	6,375,600
日清食品ホールディングス	30,200	7,330.00	221,366,000
永谷園ホールディングス	4,600	2,787.00	12,820,200
一正蒲鉾	3,300	1,096.00	3,616,800
フジッコ	7,800	2,494.00	19,453,200
ロック・フィールド	7,600	1,687.00	12,821,200
日本たばこ産業	413,600	2,823.50	1,167,799,600
ケンコーマヨネーズ	4,500	2,300.00	10,350,000
わらべや日洋ホールディングス	5,100	1,957.00	9,980,700
なとり	5,500	1,875.00	10,312,500
ピククルスコーポレーション	2,300	2,256.00	5,188,800
北の達人コーポレーション	28,900	525.00	15,172,500
ユーグレナ	29,400	698.00	20,521,200
ミヨシ油脂	3,500	1,278.00	4,473,000
理研ビタミン	3,600	3,870.00	13,932,000
片倉工業	10,000	1,218.00	12,180,000
ゲンゼ	5,100	4,455.00	22,720,500

東洋紡	30,300	1,643.00	49,782,900
ユニチカ	21,300	548.00	11,672,400
富士紡ホールディングス	3,900	3,110.00	12,129,000
倉敷紡績	6,700	2,900.00	19,430,000
シキボウ	6,300	1,164.00	7,333,200
日本毛織	23,000	919.00	21,137,000
ダイドーリミテッド	23,000	366.00	8,418,000
帝国繊維	8,000	2,454.00	19,632,000
帝人	56,700	1,960.00	111,132,000
東レ	543,100	890.30	483,521,930
住江織物	2,400	2,730.00	6,552,000
アツギ	8,100	1,071.00	8,675,100
ダイニック	6,200	807.00	5,003,400
セーレン	17,100	1,898.00	32,455,800
小松マテーレ	12,500	905.00	11,312,500
ワコールホールディングス	20,500	3,095.00	63,447,500
ホギメディカル	8,800	3,425.00	30,140,000
T S Iホールディングス	25,800	753.00	19,427,400
マツオカコーポレーション	2,500	3,245.00	8,112,500
ワールド	8,000	1,975.00	15,800,000
三陽商会	4,900	2,054.00	10,064,600
オンワードホールディングス	45,400	677.00	30,735,800
ゴールドウイン	6,300	11,770.00	74,151,000
デサント	17,000	2,223.00	37,791,000
特種東海製紙	4,500	4,625.00	20,812,500
王子ホールディングス	311,900	664.00	207,101,600
日本製紙	33,300	2,110.00	70,263,000
三菱製紙	14,800	586.00	8,672,800
北越コーポレーション	45,800	575.00	26,335,000
中越パルプ工業	4,000	1,599.00	6,396,000
巴川製紙所	3,100	1,140.00	3,534,000
大王製紙	33,100	1,394.00	46,141,400
レンゴー	72,100	963.00	69,432,300
トーモク	5,200	1,885.00	9,802,000
ザ・パック	5,400	3,230.00	17,442,000
クラレ	117,000	1,764.00	206,388,000



旭化成	497,500	1,243.00	618,392,500	
昭和電工	46,500	4,550.00	211,575,000	
住友化学	546,500	616.00	336,644,000	
住友精化	3,400	4,820.00	16,388,000	
日産化学	42,800	6,160.00	263,648,000	
ラサ工業	3,400	1,663.00	5,654,200	
クレハ	6,300	7,950.00	50,085,000	
多木化学	1,100	9,670.00	10,637,000	
テイカ	5,900	2,040.00	12,036,000	
石原産業	13,900	1,247.00	17,333,300	
日本曹達	10,900	2,708.00	29,517,200	
東ソー	107,700	1,600.00	172,320,000	
トクヤマ	20,400	3,110.00	63,444,000	
セントラル硝子	15,800	2,798.00	44,208,400	
東亜合成	44,300	1,242.00	55,020,600	
大阪ソーダ	7,500	2,657.00	19,927,500	
関東電化工業	16,900	944.00	15,953,600	
デンカ	27,400	3,660.00	100,284,000	
信越化学工業	123,200	10,135.00	1,248,632,000	
日本カーバイド工業	3,200	1,937.00	6,198,400	
堺化学工業	4,800	2,778.00	13,334,400	
第一稀元素化学工業	6,700	1,046.00	7,008,200	
エア・ウォーター	56,500	1,837.00	103,790,500	
大陽日酸	57,600	1,912.00	110,131,200	
日本化学工業	2,600	2,748.00	7,144,800	
日本パーカライジング	38,900	1,487.00	57,844,300	
高压ガス工業	12,800	887.00	11,353,600	
四国化成工業	11,800	1,246.00	14,702,800	
戸田工業	2,100	2,455.00	5,155,500	
ステラ ケミファ	4,300	3,215.00	13,824,500	
保土谷化学工業	2,900	2,589.00	7,508,100	
日本触媒	11,700	7,570.00	88,569,000	
大日精化工業	5,700	3,320.00	18,924,000	
カネカ	18,400	4,250.00	78,200,000	
三菱瓦斯化学	71,800	1,864.00	133,835,200	
三井化学	63,000	2,881.00	181,503,000	

J S R	70,200	1,817.00	127,553,400
東京応化工業	12,200	3,615.00	44,103,000
大阪有機化学工業	7,200	1,395.00	10,044,000
三菱ケミカルホールディングス	467,000	928.60	433,656,200
K Hネオケム	10,800	3,045.00	32,886,000
ダイセル	108,400	1,270.00	137,668,000
住友ベークライト	12,200	4,120.00	50,264,000
積水化学工業	151,500	1,842.00	279,063,000
日本ゼオン	63,200	1,154.00	72,932,800
アイカ工業	21,100	3,825.00	80,707,500
宇部興産	35,200	2,587.00	91,062,400
積水樹脂	11,500	2,236.00	25,714,000
タキロンシーアイ	16,900	639.00	10,799,100
旭有機材	5,300	1,851.00	9,810,300
日立化成	32,200	1,796.00	57,831,200
ニチバン	4,100	2,262.00	9,274,200
リケンテクノス	21,800	512.00	11,161,600
大倉工業	4,400	2,153.00	9,473,200
積水化成成品工業	11,300	1,081.00	12,215,300
群栄化学工業	2,400	3,150.00	7,560,000
ダイキョーニシカワ	14,600	1,148.00	16,760,800
森六ホールディングス	4,100	3,015.00	12,361,500
日本化薬	44,400	1,495.00	66,378,000
カーリットホールディングス	9,100	922.00	8,390,200
日本精化	7,300	1,108.00	8,088,400
扶桑化学工業	7,100	2,374.00	16,855,400
トリケミカル研究所	1,700	4,490.00	7,633,000
A D E K A	34,600	1,799.00	62,245,400
日油	27,000	3,750.00	101,250,000
ハリマ化成グループ	7,300	1,168.00	8,526,400
花王	173,300	8,358.00	1,448,441,400
第一工業製薬	3,000	2,753.00	8,259,000
石原ケミカル	2,800	2,137.00	5,983,600
三洋化成工業	4,600	5,620.00	25,852,000
大日本塗料	9,300	1,121.00	10,425,300
日本ペイントホールディングス	57,600	4,025.00	231,840,000

関西ペイント	78,600	2,127.00	167,182,200
中国塗料	23,200	1,042.00	24,174,400
日本特殊塗料	5,600	1,772.00	9,923,200
藤倉化成	12,600	634.00	7,988,400
太陽ホールディングス	5,700	3,655.00	20,833,500
D I C	31,600	3,605.00	113,918,000
サカタインクス	15,200	1,353.00	20,565,600
東洋インキＳＣホールディングス	14,100	2,807.00	39,578,700
T & K T O K A	6,400	1,205.00	7,712,000
富士フィルムホールディングス	148,200	4,510.00	668,382,000
資生堂	141,900	7,224.00	1,025,085,600
ライオン	99,500	2,239.00	222,780,500
高砂香料工業	5,000	3,890.00	19,450,000
マンダム	15,800	3,330.00	52,614,000
ミルボン	8,900	4,920.00	43,788,000
ファンケル	31,600	2,962.00	93,599,200
コーセー	12,100	16,930.00	204,853,000
コタ	4,400	1,566.00	6,890,400
シーズ・ホールディングス	8,700	5,860.00	50,982,000
ポーラ・オルビスホールディングス	30,500	3,205.00	97,752,500
ノエビアホールディングス	4,400	5,290.00	23,276,000
エステー	5,600	2,182.00	12,219,200
アグロ カネショウ	3,300	2,468.00	8,144,400
コニシ	12,500	1,873.00	23,412,500
長谷川香料	8,700	1,568.00	13,641,600
星光P M C	6,000	916.00	5,496,000
小林製薬	20,000	7,900.00	158,000,000
荒川化学工業	7,100	1,631.00	11,580,100
メック	5,600	1,340.00	7,504,000
日本高純度化学	3,200	2,387.00	7,638,400
タカラバイオ	18,600	2,838.00	52,786,800
J C U	9,400	1,848.00	17,371,200
デクセリアルズ	18,800	991.00	18,630,800
アース製薬	5,300	5,590.00	29,627,000
北興化学工業	10,500	558.00	5,859,000
大成ラミック	3,600	3,090.00	11,124,000

クミアイ化学工業	29,700	726.00	21,562,200
日本農薬	18,600	558.00	10,378,800
アキレス	5,800	2,256.00	13,084,800
有沢製作所	12,800	821.00	10,508,800
日東電工	54,000	6,203.00	334,962,000
レック	7,800	2,058.00	16,052,400
藤森工業	6,200	3,240.00	20,088,000
前澤化成工業	7,700	1,134.00	8,731,800
J S P	4,500	2,418.00	10,881,000
エフピコ	5,800	6,930.00	40,194,000
天馬	5,400	2,087.00	11,269,800
信越ポリマー	13,700	830.00	11,371,000
東リ	23,500	297.00	6,979,500
ニフコ	28,600	2,895.00	82,797,000
バルカー	6,100	2,753.00	16,793,300
ユニ・チャーム	151,600	3,554.00	538,786,400
協和発酵キリン	88,700	2,327.00	206,404,900
武田薬品工業	281,900	4,255.00	1,199,484,500
アステラス製薬	658,000	1,744.50	1,147,881,000
大日本住友製薬	52,900	3,700.00	195,730,000
塩野義製薬	93,400	7,508.00	701,247,200
田辺三菱製薬	73,900	1,743.00	128,807,700
あすか製薬	9,400	1,230.00	11,562,000
日本新薬	18,700	7,760.00	145,112,000
中外製薬	74,100	7,770.00	575,757,000
科研製薬	13,000	5,810.00	75,530,000
エーザイ	85,500	10,415.00	890,482,500
ロート製薬	36,700	3,585.00	131,569,500
小野薬品工業	168,900	2,745.50	463,714,950
久光製薬	21,100	7,250.00	152,975,000
持田製薬	5,500	10,310.00	56,705,000
参天製薬	135,200	1,943.00	262,693,600
扶桑薬品工業	3,800	2,842.00	10,799,600
日本ケミファ	1,600	4,135.00	6,616,000
ツムラ	22,300	3,515.00	78,384,500
日医工	17,100	1,744.00	29,822,400

キッセイ薬品工業	12,800	3,510.00	44,928,000
生化学工業	14,000	1,560.00	21,840,000
栄研化学	12,600	2,605.00	32,823,000
鳥居薬品	4,100	2,630.00	10,783,000
J C R ファーマ	5,100	5,810.00	29,631,000
東和薬品	3,400	8,440.00	28,696,000
富士製薬工業	5,300	1,923.00	10,191,900
沢井製薬	14,800	6,000.00	88,800,000
ゼリア新薬工業	14,200	2,104.00	29,876,800
第一三共	204,300	4,167.00	851,318,100
キョーリン製薬ホールディングス	18,300	2,728.00	49,922,400
大幸薬品	4,100	2,010.00	8,241,000
ダイト	4,300	3,420.00	14,706,000
大塚ホールディングス	136,000	5,535.00	752,760,000
大正製薬ホールディングス	15,900	13,120.00	208,608,000
ペプチドリーム	33,100	4,650.00	153,915,000
日本コークス工業	75,000	106.00	7,950,000
昭和シェル石油	66,900	1,759.00	117,677,100
ニチレキ	10,100	1,144.00	11,554,400
ユシロ化学工業	5,100	1,356.00	6,915,600
富士石油	19,700	340.00	6,698,000
MORESCO	3,800	1,664.00	6,323,200
出光興産	55,200	4,130.00	227,976,000
J X T Gホールディングス	1,215,300	686.30	834,060,390
コスモエネルギーホールディングス	20,200	2,649.00	53,509,800
横浜ゴム	41,600	2,376.00	98,841,600
東洋ゴム工業	37,300	1,793.00	66,878,900
ブリヂストン	219,500	4,600.00	1,009,700,000
住友ゴム工業	64,300	1,517.00	97,543,100
オカモト	5,100	5,970.00	30,447,000
ニッタ	8,000	3,910.00	31,280,000
住友理工	14,100	1,112.00	15,679,200
三ツ星ベルト	9,600	2,461.00	23,625,600
バンドー化学	14,200	1,233.00	17,508,600
日東紡績	10,600	2,174.00	23,044,400
A G C	71,500	3,855.00	275,632,500

日本板硝子	33,500	968.00	32,428,000
日本山村硝子	4,200	1,782.00	7,484,400
日本電気硝子	30,900	3,050.00	94,245,000
オハラ	3,100	2,389.00	7,405,900
住友大阪セメント	14,600	5,100.00	74,460,000
太平洋セメント	45,000	3,840.00	172,800,000
日本ヒューム	8,900	960.00	8,544,000
日本コンクリート工業	20,500	308.00	6,314,000
三谷セキサン	3,700	2,841.00	10,511,700
アジアパイルホールディングス	11,700	694.00	8,119,800
東海カーボン	64,700	1,576.00	101,967,200
日本カーボン	3,500	5,420.00	18,970,000
東洋炭素	4,400	2,737.00	12,042,800
ノリタケカンパニーリミテド	4,300	5,630.00	24,209,000
TOTO	54,700	4,395.00	240,406,500
日本碍子	86,500	1,683.00	145,579,500
日本特殊陶業	60,000	2,332.00	139,920,000
MARUWA	2,600	6,420.00	16,692,000
品川リフラクトリーズ	2,200	4,305.00	9,471,000
黒崎播磨	1,500	6,750.00	10,125,000
ヨータイ	7,800	686.00	5,350,800
東京窯業	12,600	466.00	5,871,600
ニッカトー	4,300	1,079.00	4,639,700
フジインコーポレーテッド	6,400	2,436.00	15,590,400
ニチアス	19,300	2,203.00	42,517,900
ニチハ	9,900	3,105.00	30,739,500
新日鐵住金	316,000	2,076.00	656,016,000
神戸製鋼所	129,400	934.00	120,859,600
中山製鋼所	11,900	585.00	6,961,500
合同製鐵	4,100	1,946.00	7,978,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	190,700	2,001.50	381,686,050
日新製鋼	17,200	1,465.00	25,198,000
東京製鐵	37,700	978.00	36,870,600
共英製鋼	8,000	2,200.00	17,600,000
大和工業	15,200	2,968.00	45,113,600
東京鐵鋼	4,100	1,371.00	5,621,100

大阪製鐵	5,100	2,001.00	10,205,100
淀川製鋼所	9,200	2,429.00	22,346,800
丸一鋼管	25,100	3,370.00	84,587,000
モリ工業	2,700	2,716.00	7,333,200
大同特殊鋼	11,800	4,595.00	54,221,000
日本冶金工業	61,400	282.00	17,314,800
山陽特殊製鋼	8,900	2,580.00	22,962,000
愛知製鋼	3,900	3,995.00	15,580,500
日立金属	77,700	1,278.00	99,300,600
大太平洋金属	5,000	3,320.00	16,600,000
新日本電工	46,400	268.00	12,435,200
栗本鐵工所	4,600	1,645.00	7,567,000
三菱製鋼	6,000	2,029.00	12,174,000
シンニッタン	14,700	413.00	6,071,100
大紀アルミニウム工業所	13,100	651.00	8,528,100
日本軽金属ホールディングス	196,200	254.00	49,834,800
三井金属鉱業	19,400	2,593.00	50,304,200
東邦亜鉛	4,000	3,830.00	15,320,000
三菱マテリアル	46,600	3,185.00	148,421,000
住友金属鉱山	97,000	3,305.00	320,585,000
D O W Aホールディングス	16,600	3,740.00	62,084,000
古河機械金属	11,800	1,439.00	16,980,200
大阪チタニウムテクノロジーズ	8,600	2,119.00	18,223,400
東邦チタニウム	13,200	1,395.00	18,414,000
U A C J	10,500	2,377.00	24,958,500
C Kサンエツ	1,700	2,760.00	4,692,000
古河電気工業	20,600	3,315.00	68,289,000
住友電気工業	264,200	1,592.50	420,738,500
フジクラ	87,200	493.00	42,989,600
タツタ電線	16,300	537.00	8,753,100
平河ヒューテック	3,600	1,324.00	4,766,400
リョービ	8,800	3,095.00	27,236,000
アーレスティ	10,200	730.00	7,446,000
アサヒホールディングス	13,400	2,351.00	31,503,400
稲葉製作所	5,700	1,357.00	7,734,900
宮地エンジニアリンググループ	2,700	2,148.00	5,799,600

トーカロ	19,600	990.00	19,404,000	
アルファコ	4,000	1,395.00	5,580,000	
SUMCO	78,500	1,740.00	136,590,000	
川田テクノロジーズ	1,700	8,530.00	14,501,000	
RS Technologies	1,600	5,040.00	8,064,000	
東洋製罐グループホールディングス	44,900	2,585.00	116,066,500	
ホッカンホールディングス	4,800	1,717.00	8,241,600	
コロナ	5,600	1,141.00	6,389,600	
横河ブリッジホールディングス	13,300	1,860.00	24,738,000	
三和ホールディングス	73,200	1,378.00	100,869,600	
文化シャッター	21,500	784.00	16,856,000	
三協立山	10,200	1,317.00	13,433,400	
アルインコ	8,900	1,099.00	9,781,100	
LIXILグループ	104,200	1,471.00	153,278,200	
ノーリツ	15,700	1,688.00	26,501,600	
長府製作所	7,000	2,388.00	16,716,000	
リンナイ	12,600	8,140.00	102,564,000	
日東精工	12,500	643.00	8,037,500	
岡部	15,200	990.00	15,048,000	
ジーテクト	8,300	1,591.00	13,205,300	
東プレ	12,800	2,312.00	29,593,600	
高周波熱錬	14,400	1,024.00	14,745,600	
東京製綱	5,900	1,153.00	6,802,700	
パイオラックス	11,200	2,780.00	31,136,000	
エイチワン	8,000	1,100.00	8,800,000	
日本発條	71,000	1,010.00	71,710,000	
三益半導体工業	6,100	1,545.00	9,424,500	
日本製鋼所	21,800	2,074.00	45,213,200	
三浦工業	30,700	3,025.00	92,867,500	
タクマ	25,700	1,595.00	40,991,500	
ツガミ	16,100	852.00	13,717,200	
オークマ	9,000	5,650.00	50,850,000	
東芝機械	8,000	1,984.00	15,872,000	
アマダホールディングス	107,800	1,232.00	132,809,600	
アイダエンジニアリング	19,500	909.00	17,725,500	
FUJI	20,600	1,493.00	30,755,800	



牧野フライス製作所	8,100	4,605.00	37,300,500
オーエスジー	35,000	2,279.00	79,765,000
旭ダイヤモンド工業	19,200	702.00	13,478,400
D M G 森精機	44,900	1,590.00	71,391,000
ソディック	15,600	838.00	13,072,800
ディスコ	9,600	16,550.00	158,880,000
日東工器	4,400	2,510.00	11,044,000
日進工具	2,400	2,651.00	6,362,400
豊和工業	5,000	864.00	4,320,000
津田駒工業	2,200	2,216.00	4,875,200
島精機製作所	9,800	3,515.00	34,447,000
オプトラン	7,100	2,459.00	17,458,900
フリュー	7,600	1,025.00	7,790,000
ヤマシンフィルタ	12,900	905.00	11,674,500
日阪製作所	10,100	953.00	9,625,300
やまびこ	13,700	1,298.00	17,782,600
平田機工	3,400	6,040.00	20,536,000
ペガサスミシン製造	8,600	831.00	7,146,600
ナプテスコ	39,000	3,140.00	122,460,000
三井海洋開発	7,500	2,825.00	21,187,500
レオン自動機	7,100	1,822.00	12,936,200
S M C	20,900	38,480.00	804,232,000
ホソカワミクロン	2,600	5,170.00	13,442,000
ユニオンツール	3,200	3,630.00	11,616,000
オイレス工業	9,800	1,997.00	19,570,600
日精エー・エス・ビー機械	2,300	4,065.00	9,349,500
サトーホールディングス	8,600	2,995.00	25,757,000
技研製作所	4,900	4,140.00	20,286,000
日精樹脂工業	7,300	1,021.00	7,453,300
オカダアイヨン	3,200	1,718.00	5,497,600
小松製作所	323,300	3,033.00	980,568,900
住友重機械工業	40,500	3,765.00	152,482,500
日立建機	28,500	3,135.00	89,347,500
日工	2,700	2,505.00	6,763,500
巴工業	3,700	2,366.00	8,754,200
井関農機	7,500	1,847.00	13,852,500

T O W A	7,300	741.00	5,409,300	
北川鉄工所	3,700	2,573.00	9,520,100	
ローツェ	3,600	1,859.00	6,692,400	
クボタ	382,800	1,937.00	741,483,600	
荏原実業	3,500	2,005.00	7,017,500	
三菱化工機	3,900	1,731.00	6,750,900	
月島機械	14,200	1,330.00	18,886,000	
帝国電機製作所	5,800	1,656.00	9,604,800	
新東工業	17,000	980.00	16,660,000	
澁谷工業	6,300	4,135.00	26,050,500	
アイチ コーポレーション	14,200	657.00	9,329,400	
小森コーポレーション	19,100	1,252.00	23,913,200	
鶴見製作所	6,000	1,988.00	11,928,000	
住友精密工業	1,800	3,515.00	6,327,000	
酒井重工業	1,800	2,694.00	4,849,200	
荏原製作所	31,800	2,944.00	93,619,200	
西島製作所	9,800	1,042.00	10,211,600	
北越工業	8,100	1,262.00	10,222,200	
ダイキン工業	97,400	12,610.00	1,228,214,000	
オルガノ	3,100	3,140.00	9,734,000	
トーヨーカネツ	3,100	2,414.00	7,483,400	
栗田工業	38,500	3,045.00	117,232,500	
樁本チエイン	9,100	4,245.00	38,629,500	
大同工業	5,700	1,076.00	6,133,200	
アネスト岩田	11,800	1,232.00	14,537,600	
ダイフク	39,300	5,810.00	228,333,000	
加藤製作所	3,900	3,035.00	11,836,500	
タダノ	35,000	1,361.00	47,635,000	
フジテック	25,500	1,394.00	35,547,000	
C K D	19,900	1,141.00	22,705,900	
キトー	6,100	1,871.00	11,413,100	
平和	19,700	2,418.00	47,634,600	
理想科学工業	6,200	1,938.00	12,015,600	
S A N K Y O	17,900	4,540.00	81,266,000	
日本金銭機械	9,000	1,128.00	10,152,000	
マースグループホールディングス	5,100	2,344.00	11,954,400	

福島工業	4,300	4,375.00	18,812,500	
ダイコク電機	4,300	1,701.00	7,314,300	
竹内製作所	11,900	2,285.00	27,191,500	
アマノ	20,700	2,448.00	50,673,600	
J U K I	10,200	1,515.00	15,453,000	
サンデンホールディングス	9,300	880.00	8,184,000	
蛇の目マシン工業	9,900	567.00	5,613,300	
マックス	10,900	1,492.00	16,262,800	
グローリー	19,900	2,871.00	57,132,900	
新晃工業	7,400	1,650.00	12,210,000	
大和冷機工業	10,300	1,314.00	13,534,200	
セガサミーホールディングス	71,000	1,602.00	113,742,000	
日本ピストンリング	3,500	2,086.00	7,301,000	
リケン	3,300	5,660.00	18,678,000	
T P R	9,400	2,699.00	25,370,600	
ツバキ・ナカシマ	11,000	1,933.00	21,263,000	
ホシザキ	20,800	8,810.00	183,248,000	
大豊工業	6,900	1,115.00	7,693,500	
日本精工	145,000	1,067.00	154,715,000	
N T N	152,200	381.00	57,988,200	
ジェイテクト	67,600	1,444.00	97,614,400	
不二越	6,800	4,850.00	32,980,000	
日本トムソン	22,300	628.00	14,004,400	
T H K	44,700	2,601.00	116,264,700	
ユーシン精機	6,300	1,174.00	7,396,200	
前澤給装工業	4,100	1,933.00	7,925,300	
イーグル工業	9,300	1,489.00	13,847,700	
日本ピラー工業	8,300	1,538.00	12,765,400	
キッツ	28,900	972.00	28,090,800	
マキタ	86,600	4,455.00	385,803,000	
日立造船	54,200	390.00	21,138,000	
三菱重工業	119,700	4,317.00	516,744,900	
I H I	54,800	3,455.00	189,334,000	
スター精密	12,500	1,692.00	21,150,000	
日清紡ホールディングス	39,600	1,033.00	40,906,800	
イビデン	44,100	1,579.00	69,633,900	

コニカミノルタ	156,200	1,022.00	159,636,400
ブラザー工業	92,700	1,897.00	175,851,900
ミネベアミツミ	132,300	1,842.00	243,696,600
日立製作所	321,100	3,288.00	1,055,776,800
三菱電機	713,200	1,498.00	1,068,373,600
富士電機	46,300	3,565.00	165,059,500
東洋電機製造	4,000	1,534.00	6,136,000
安川電機	82,800	3,540.00	293,112,000
シンフォニアテクノロジー	10,300	1,689.00	17,396,700
明電舎	14,200	1,606.00	22,805,200
オリジン電気	3,200	1,932.00	6,182,400
山洋電気	3,600	4,360.00	15,696,000
デンヨー	7,500	1,604.00	12,030,000
東芝テック	8,800	3,065.00	26,972,000
芝浦メカトロニクス	1,700	4,060.00	6,902,000
マブチモーター	19,600	3,955.00	77,518,000
日本電産	85,900	15,120.00	1,298,808,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	4,200	2,491.00	10,462,200
トレックス・セミコンダクター	3,200	1,559.00	4,988,800
東光高岳	4,400	1,582.00	6,960,800
ダブル・スコープ	10,900	1,379.00	15,031,100
ダイヘン	7,900	2,775.00	21,922,500
ヤーマン	10,600	1,871.00	19,832,600
JVCケンウッド	53,200	288.00	15,321,600
ミマキエンジニアリング	7,300	929.00	6,781,700
第一精工	3,900	1,384.00	5,397,600
日新電機	17,000	951.00	16,167,000
大崎電気工業	15,900	813.00	12,926,700
オムロン	75,700	4,990.00	377,743,000
日東工業	11,600	1,928.00	22,364,800
I D E C	9,900	2,517.00	24,918,300
ジーエス・ユアサ コーポレーション	26,000	2,623.00	68,198,000
サクサホールディングス	2,700	2,017.00	5,445,900
メルコホールディングス	3,000	3,890.00	11,670,000
日本電気	92,000	3,520.00	323,840,000
富士通	68,900	6,987.00	481,404,300

沖電気工業	31,400	1,500.00	47,100,000
電気興業	4,300	2,960.00	12,728,000
サンケン電気	8,600	2,419.00	20,803,400
アイホン	5,400	1,717.00	9,271,800
ルネサスエレクトロニクス	73,000	535.00	39,055,000
セイコーエプソン	88,400	1,804.00	159,473,600
ワコム	53,000	574.00	30,422,000
アルバック	16,600	4,170.00	69,222,000
E I Z O	6,600	4,750.00	31,350,000
ジャパンディスプレイ	93,000	70.00	6,510,000
日本信号	18,300	1,012.00	18,519,600
京三製作所	18,500	505.00	9,342,500
能美防災	9,500	2,254.00	21,413,000
ホーチキ	5,300	1,313.00	6,958,900
エレコム	6,500	3,005.00	19,532,500
パナソニック	815,100	1,164.50	949,183,950
シャープ	71,100	1,684.00	119,732,400
アンリツ	45,800	1,861.00	85,233,800
富士通ゼネラル	22,300	1,603.00	35,746,900
ソニー	478,400	5,937.00	2,840,260,800
T D K	37,300	8,950.00	333,835,000
帝国通信工業	5,400	1,219.00	6,582,600
タムラ製作所	28,100	656.00	18,433,600
アルプス電気	65,300	2,631.00	171,804,300
日本トリム	1,600	6,200.00	9,920,000
ローランド ディー . ジー .	4,300	2,461.00	10,582,300
フォスター電機	8,800	1,547.00	13,613,600
クラリオン	6,200	2,490.00	15,438,000
S M K	2,600	2,552.00	6,635,200
ヨコオ	5,700	1,729.00	9,855,300
ホシデン	21,300	880.00	18,744,000
ヒロセ電機	10,300	11,970.00	123,291,000
日本航空電子工業	16,400	1,430.00	23,452,000
T O A	8,600	1,228.00	10,560,800
マクセルホールディングス	15,300	1,592.00	24,357,600
古野電気	9,700	1,292.00	12,532,400

ユニデンホールディングス	2,800	2,521.00	7,058,800
アルパイン	12,900	1,839.00	23,723,100
スミダコーポレーション	7,000	1,520.00	10,640,000
アイコム	4,400	2,352.00	10,348,800
リオン	3,800	2,032.00	7,721,600
本多通信工業	7,600	629.00	4,780,400
船井電機	10,700	747.00	7,992,900
横河電機	71,400	2,086.00	148,940,400
新電元工業	2,700	4,675.00	12,622,500
アズビル	46,200	2,450.00	113,190,000
東亜ディーケーケー	4,600	958.00	4,406,800
日本光電工業	31,600	3,695.00	116,762,000
チノー	4,500	1,481.00	6,664,500
共和電業	11,700	421.00	4,925,700
堀場製作所	14,300	5,320.00	76,076,000
アドバンテスト	49,100	2,436.00	119,607,600
エスベック	6,900	2,107.00	14,538,300
キーエンス	35,000	61,600.00	2,156,000,000
日置電機	3,900	4,240.00	16,536,000
シスメックス	55,600	6,049.00	336,324,400
日本マイクロニクス	12,900	981.00	12,654,900
メガチップス	6,000	2,749.00	16,494,000
OBARA GROUP	4,200	4,860.00	20,412,000
コーセル	10,900	1,160.00	12,644,000
イリソ電子工業	6,500	4,975.00	32,337,500
オブテックスグループ	12,800	2,304.00	29,491,200
千代田インテグレ	3,600	2,440.00	8,784,000
アイ・オー・データ機器	4,100	1,181.00	4,842,100
レーザーテック	14,700	3,655.00	53,728,500
スタンレー電気	50,500	3,305.00	166,902,500
岩崎電気	4,700	1,524.00	7,162,800
ウシオ電機	43,700	1,272.00	55,586,400
ヘリオス テクノ ホールディング	7,600	786.00	5,973,600
日本セラミック	7,400	2,860.00	21,164,000
古河電池	6,800	829.00	5,637,200
山一電機	5,800	1,535.00	8,903,000

図研	5,400	1,766.00	9,536,400
日本電子	14,300	1,987.00	28,414,100
カシオ計算機	63,200	1,583.00	100,045,600
ファナック	67,800	19,390.00	1,314,642,000
日本シイエムケイ	19,400	900.00	17,460,000
エンプラス	3,600	3,135.00	11,286,000
ローム	34,500	7,900.00	272,550,000
浜松ホトニクス	51,100	3,950.00	201,845,000
三井ハイテック	8,500	1,285.00	10,922,500
新光電気工業	23,700	803.00	19,031,100
京セラ	108,800	6,125.00	666,400,000
太陽誘電	32,100	2,153.00	69,111,300
村田製作所	74,900	17,315.00	1,296,893,500
ユーシン	13,900	985.00	13,691,500
双葉電子工業	11,600	1,779.00	20,636,400
ニチコン	22,900	902.00	20,655,800
日本ケミコン	5,400	2,343.00	12,652,200
K O A	11,200	1,527.00	17,102,400
市光工業	11,300	744.00	8,407,200
小糸製作所	42,500	6,090.00	258,825,000
ミツバ	14,000	747.00	10,458,000
S C R E E Nホールディングス	12,500	5,680.00	71,000,000
キヤノン電子	6,500	2,143.00	13,929,500
キヤノン	384,400	3,220.00	1,237,768,000
リコー	214,300	1,102.00	236,158,600
象印マホービン	13,600	1,171.00	15,925,600
東京エレクトロン	47,600	15,875.00	755,650,000
トヨタ紡織	24,900	1,749.00	43,550,100
ユニプレス	14,500	2,138.00	31,001,000
豊田自動織機	57,500	5,820.00	334,650,000
モリタホールディングス	12,500	2,238.00	27,975,000
三櫻工業	11,200	648.00	7,257,600
デンソー	158,200	5,247.00	830,075,400
東海理化電機製作所	19,000	2,085.00	39,615,000
三井E & Sホールディングス	26,400	1,231.00	32,498,400
川崎重工業	55,500	2,643.00	146,686,500

名村造船所	23,500	559.00	13,136,500	
日本車輛製造	3,100	2,646.00	8,202,600	
三菱ロジスネクスト	9,200	1,310.00	12,052,000	
日産自動車	841,400	994.30	836,604,020	
いすゞ自動車	226,200	1,616.00	365,539,200	
トヨタ自動車	795,500	6,803.00	5,411,786,500	代用有価証券 400,000株
日野自動車	88,900	1,160.00	103,124,000	
三菱自動車工業	263,900	696.00	183,674,400	
エフテック	6,700	1,113.00	7,457,100	
武蔵精密工業	16,800	1,796.00	30,172,800	
日産車体	14,800	943.00	13,956,400	
新明和工業	33,000	1,527.00	50,391,000	
極東開発工業	14,400	1,646.00	23,702,400	
日信工業	12,800	1,504.00	19,251,200	
トピー工業	6,000	2,678.00	16,068,000	
ティラド	3,300	2,557.00	8,438,100	
タチエス	12,300	1,599.00	19,667,700	
N O K	38,500	1,710.00	65,835,000	
フタバ産業	20,300	612.00	12,423,600	
K Y B	7,600	2,827.00	21,485,200	
大同メタル工業	13,300	950.00	12,635,000	
プレス工業	35,900	613.00	22,006,700	
ミクニ	11,200	588.00	6,585,600	
太平洋工業	14,900	1,703.00	25,374,700	
ケーヒン	16,100	1,964.00	31,620,400	
河西工業	9,900	997.00	9,870,300	
アイシン精機	58,500	4,490.00	262,665,000	
マツダ	224,900	1,210.00	272,129,000	
今仙電機製作所	8,800	1,060.00	9,328,000	
本田技研工業	602,000	3,202.00	1,927,604,000	
スズキ	130,700	5,655.00	739,108,500	
S U B A R U	221,600	2,523.00	559,096,800	
安永	3,900	1,914.00	7,464,600	
ヤマハ発動機	100,500	2,335.00	234,667,500	
ショーワ	16,900	1,518.00	25,654,200	



T B K	16,500	448.00	7,392,000	
エクセディ	9,200	2,914.00	26,808,800	
豊田合成	23,200	2,185.00	50,692,000	
愛三工業	12,900	831.00	10,719,900	
日本プラスト	7,400	923.00	6,830,200	
ヨロズ	7,400	1,494.00	11,055,600	
エフ・シー・シー	12,700	2,951.00	37,477,700	
シマノ	28,700	16,580.00	475,846,000	
テイ・エス テック	16,800	3,290.00	55,272,000	
ジャムコ	3,900	3,205.00	12,499,500	
テルモ	100,700	6,685.00	673,179,500	
日機装	23,200	1,132.00	26,262,400	
島津製作所	91,400	2,654.00	242,575,600	
J M S	12,000	595.00	7,140,000	
長野計器	7,400	957.00	7,081,800	
ブイ・テクノロジー	1,700	15,930.00	27,081,000	
東京計器	6,000	1,109.00	6,654,000	
インターアクション	4,300	2,580.00	11,094,000	
東京精密	12,700	3,380.00	42,926,000	
マニー	8,800	5,340.00	46,992,000	
ニコン	123,900	1,780.00	220,542,000	
トプコン	38,600	1,751.00	67,588,600	
オリンパス	105,900	3,195.00	338,350,500	
理研計器	6,400	2,376.00	15,206,400	
タムロン	6,400	1,828.00	11,699,200	
H O Y A	143,700	6,900.00	991,530,000	
シード	3,500	1,584.00	5,544,000	
ノーリツ鋼機	5,800	1,955.00	11,339,000	
エー・アンド・デイ	7,900	833.00	6,580,700	
朝日インテック	25,600	5,320.00	136,192,000	
シチズン時計	78,400	600.00	47,040,000	
リズム時計工業	3,500	2,045.00	7,157,500	
大研医器	8,500	765.00	6,502,500	
メニコン	9,900	2,993.00	29,630,700	
松風	3,200	1,233.00	3,945,600	
セイコーホールディングス	11,100	2,520.00	27,972,000	

ニプロ	49,900	1,543.00	76,995,700
スノーピーク	3,200	1,387.00	4,438,400
パラマウントベッドホールディングス	8,100	4,795.00	38,839,500
トランザクション	5,100	827.00	4,217,700
ニホンフラッシュ	3,600	2,080.00	7,488,000
前田工織	8,100	2,606.00	21,108,600
永大産業	16,800	449.00	7,543,200
アートネイチャー	10,700	682.00	7,297,400
バンダイナムコホールディングス	73,700	4,770.00	351,549,000
S H O E I	3,500	4,435.00	15,522,500
フランスベッドホールディングス	12,800	969.00	12,403,200
パイロットコーポレーション	12,600	5,870.00	73,962,000
萩原工業	4,700	1,710.00	8,037,000
トッパン・フォームズ	15,100	1,041.00	15,719,100
フジシールインターナショナル	15,900	4,090.00	65,031,000
タカラトミー	30,100	1,416.00	42,621,600
廣済堂	12,000	428.00	5,136,000
プロネクサス	7,900	1,147.00	9,061,300
大建工業	5,800	2,116.00	12,272,800
凸版印刷	99,600	1,828.00	182,068,800
大日本印刷	100,000	2,626.00	262,600,000
図書印刷	8,100	830.00	6,723,000
共同印刷	3,300	2,651.00	8,748,300
N I S S H A	14,900	1,781.00	26,536,900
宝印刷	5,100	1,841.00	9,389,100
アシックス	71,000	1,636.00	116,156,000
ヤマハ	42,400	4,890.00	207,336,000
河合楽器製作所	2,500	4,030.00	10,075,000
クリナップ	9,500	725.00	6,887,500
ピジョン	43,300	4,675.00	202,427,500
キングジム	8,800	914.00	8,043,200
リンテック	17,200	2,570.00	44,204,000
イトーキ	15,800	617.00	9,748,600
任天堂	44,000	34,610.00	1,522,840,000
三菱鉛筆	11,700	2,177.00	25,470,900
タカラスタンダード	14,300	1,778.00	25,425,400

コクヨ	34,400	1,749.00	60,165,600	
ナカバヤシ	7,800	591.00	4,609,800	
グロープライド	3,900	2,889.00	11,267,100	
オカムラ	24,600	1,637.00	40,270,200	
美津濃	7,100	2,582.00	18,332,200	
東京電力ホールディングス	568,100	689.00	391,420,900	
中部電力	218,200	1,702.00	371,376,400	
関西電力	291,200	1,704.00	496,204,800	
中国電力	97,500	1,434.00	139,815,000	
北陸電力	70,100	1,011.00	70,871,100	
東北電力	166,500	1,484.00	247,086,000	
四国電力	64,300	1,365.00	87,769,500	
九州電力	145,800	1,333.00	194,351,400	
北海道電力	67,500	778.00	52,515,000	
沖縄電力	13,100	2,258.00	29,579,800	
電源開発	56,500	2,922.00	165,093,000	
エフオン	5,200	1,022.00	5,314,400	
イーレックス	12,900	693.00	8,939,700	
レノバ	7,700	1,166.00	8,978,200	
東京瓦斯	140,200	2,924.50	410,014,900	
大阪瓦斯	139,100	2,069.00	287,797,900	
東邦瓦斯	35,200	4,590.00	161,568,000	
北海道瓦斯	5,000	1,504.00	7,520,000	
広島ガス	20,500	361.00	7,400,500	
西部瓦斯	8,100	2,498.00	20,233,800	
静岡ガス	21,700	977.00	21,200,900	
メタウォーター	3,800	3,185.00	12,103,000	
SBSホールディングス	7,800	1,369.00	10,678,200	
東武鉄道	74,800	3,250.00	243,100,000	
相鉄ホールディングス	24,500	3,450.00	84,525,000	
東京急行電鉄	193,500	1,976.00	382,356,000	
京浜急行電鉄	97,900	1,811.00	177,296,900	
小田急電鉄	113,600	2,545.00	289,112,000	
京王電鉄	39,600	6,280.00	248,688,000	
京成電鉄	53,300	3,680.00	196,144,000	
富士急行	9,800	3,220.00	31,556,000	

新京成電鉄	3,400	2,122.00	7,214,800	
東日本旅客鉄道	126,900	10,320.00	1,309,608,000	
西日本旅客鉄道	64,200	7,909.00	507,757,800	
東海旅客鉄道	63,900	23,325.00	1,490,467,500	
西武ホールディングス	91,000	2,098.00	190,918,000	
鴻池運輸	11,200	1,783.00	19,969,600	
西日本鉄道	20,000	2,958.00	59,160,000	
ハマキョウレックス	5,500	4,205.00	23,127,500	
サカイ引越センター	3,800	6,430.00	24,434,000	
近鉄グループホールディングス	67,200	4,730.00	317,856,000	
阪急阪神ホールディングス	90,000	3,850.00	346,500,000	
南海電気鉄道	30,400	3,035.00	92,264,000	
京阪ホールディングス	29,900	4,740.00	141,726,000	
神戸電鉄	2,700	4,000.00	10,800,000	
名古屋鉄道	53,700	2,845.00	152,776,500	
山陽電気鉄道	5,600	2,363.00	13,232,800	
日本通運	26,400	6,840.00	180,576,000	
ヤマトホールディングス	118,800	2,998.50	356,221,800	
山九	18,800	5,320.00	100,016,000	
丸全昭和運輸	5,500	3,115.00	17,132,500	
センコーグループホールディングス	37,200	884.00	32,884,800	
トナミホールディングス	1,800	6,520.00	11,736,000	
ニッコンホールディングス	25,900	2,907.00	75,291,300	
福山通運	8,600	4,980.00	42,828,000	
セイノーホールディングス	50,800	1,685.00	85,598,000	
神奈川中央交通	2,500	3,905.00	9,762,500	
日立物流	14,300	3,070.00	43,901,000	
丸和運輸機関	3,600	3,355.00	12,078,000	
C & F ロジホールディングス	8,600	1,300.00	11,180,000	
九州旅客鉄道	56,800	3,750.00	213,000,000	
S Gホールディングス	63,900	2,779.00	177,578,100	
日本郵船	56,000	1,927.00	107,912,000	
商船三井	39,900	2,669.00	106,493,100	
川崎汽船	21,200	1,631.00	34,577,200	
N S ユナイテッド海運	4,100	3,060.00	12,546,000	
飯野海運	33,800	451.00	15,243,800	

乾汽船	8,000	1,027.00	8,216,000	
日本航空	124,100	4,094.00	508,065,400	
A N Aホールディングス	124,100	4,051.00	502,729,100	
ランコム	1,900	6,520.00	12,388,000	
日新	6,000	1,956.00	11,736,000	
三菱倉庫	23,400	2,804.00	65,613,600	
三井倉庫ホールディングス	8,600	2,005.00	17,243,000	
住友倉庫	26,100	1,457.00	38,027,700	
澁澤倉庫	5,500	1,662.00	9,141,000	
東陽倉庫	25,300	314.00	7,944,200	
日本トランスシティ	19,500	492.00	9,594,000	
川西倉庫	2,600	1,663.00	4,323,800	
安田倉庫	8,700	875.00	7,612,500	
東洋埠頭	2,400	1,559.00	3,741,600	
上組	42,200	2,549.00	107,567,800	
キューソー流通システム	2,300	2,509.00	5,770,700	
近鉄エクスプレス	12,600	1,913.00	24,103,800	
エーアイティー	5,400	1,019.00	5,502,600	
N E C ネットエスアイ	7,600	2,528.00	19,212,800	
システナ	25,300	1,461.00	36,963,300	
デジタルアーツ	3,900	6,490.00	25,311,000	
新日鉄住金ソリューションズ	10,400	3,245.00	33,748,000	
キューブシステム	6,100	771.00	4,703,100	
コア	4,400	1,401.00	6,164,400	
ソリトンシステムズ	5,300	906.00	4,801,800	
ソフトクリエイティブホールディングス	4,400	1,739.00	7,651,600	
T I S	23,400	5,240.00	122,616,000	
ネオス	2,900	1,335.00	3,871,500	
電算システム	3,900	2,273.00	8,864,700	
グリー	38,000	496.00	18,848,000	
コーエーテクモホールディングス	14,400	1,884.00	27,129,600	
三菱総合研究所	3,000	3,860.00	11,580,000	
ファインデックス	8,100	722.00	5,848,200	
ブレインパッド	1,600	7,370.00	11,792,000	
K L a b	13,000	1,188.00	15,444,000	

ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	4,900	2,625.00	12,862,500
イーブックイニシアティブジャパン	1,500	1,757.00	2,635,500
ネクソン	178,600	1,342.00	239,681,200
アイスタイル	18,400	1,163.00	21,399,200
エムアップ	2,700	2,203.00	5,948,100
エイチーム	4,900	1,695.00	8,305,500
テクノスジャパン	6,900	1,022.00	7,051,800
コロプラ	20,800	855.00	17,784,000
ブロードリーフ	36,300	635.00	23,050,500
デジタルハーツホールディングス	4,300	1,670.00	7,181,000
メディアドゥホールディングス	2,400	2,771.00	6,650,400
じげん	9,300	669.00	6,221,700
フィックスターズ	7,300	1,353.00	9,876,900
VOYAGE GROUP	4,800	1,264.00	6,067,200
オブティム	1,800	4,775.00	8,595,000
セレス	2,800	2,134.00	5,975,200
ティーガイア	6,900	2,422.00	16,711,800
セック	1,400	4,390.00	6,146,000
豆蔵ホールディングス	7,100	1,072.00	7,611,200
テクマトリックス	5,400	1,890.00	10,206,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	174,500	252.00	43,974,000
GMOペイメントゲートウェイ	11,600	6,990.00	81,084,000
システムリサーチ	1,200	3,605.00	4,326,000
インターネットイニシアティブ	11,600	2,792.00	32,387,200
さくらインターネット	10,500	592.00	6,216,000
ヴィンクス	2,700	1,836.00	4,957,200
GMOクラウド	2,000	4,010.00	8,020,000
SRAホールディングス	4,100	3,040.00	12,464,000
eBASE	2,900	1,729.00	5,014,100
アドソル日進	2,900	1,962.00	5,689,800
フリービット	5,800	988.00	5,730,400
コムチュア	4,200	3,325.00	13,965,000
アステリア	4,400	904.00	3,977,600
マークライنز	3,300	1,524.00	5,029,200
メディカル・データ・ビジョン	6,600	1,026.00	6,771,600

g u m i	9,100	742.00	6,752,200	
モバイルファクトリー	2,500	1,354.00	3,385,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	3,600	1,613.00	5,806,800	
P C Iホールディングス	1,700	2,794.00	4,749,800	
オープンドア	3,800	3,325.00	12,635,000	
アカツキ	2,600	5,540.00	14,404,000	
L I N E	21,600	4,080.00	88,128,000	
オークネット	5,200	1,120.00	5,824,000	
A O I T Y O H o l d i n g s	8,300	1,050.00	8,715,000	
マクロミル	9,200	1,781.00	16,385,200	
オロ	900	3,805.00	3,424,500	
フェイス	4,500	1,193.00	5,368,500	
野村総合研究所	44,500	4,985.00	221,832,500	
サイバネットシステム	7,600	676.00	5,137,600	
インテージホールディングス	10,700	1,019.00	10,903,300	
ソースネクスト	28,200	736.00	20,755,200	
フォーカスシステムズ	6,000	1,114.00	6,684,000	
クレスコ	2,400	3,850.00	9,240,000	
フジ・メディア・ホールディングス	73,000	1,769.00	129,137,000	
オービック	24,300	9,810.00	238,383,000	
ジャストシステム	10,100	2,551.00	25,765,100	
T D C ソフト	7,100	973.00	6,908,300	
ヤフー	457,500	325.00	148,687,500	
トレンドマイクロ	37,400	6,510.00	243,474,000	
日本オラクル	11,400	7,370.00	84,018,000	
アルファシステムズ	2,900	2,666.00	7,731,400	
フューチャー	10,100	1,753.00	17,705,300	
C A C H o l d i n g s	7,700	1,074.00	8,269,800	
ソフトバンク・テクノロジー	3,200	2,118.00	6,777,600	
オービックビジネスコンサルタント	3,600	9,940.00	35,784,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	32,000	2,189.00	70,048,000	
アイティフォー	9,900	855.00	8,464,500	
大塚商会	37,900	3,820.00	144,778,000	
サイボウズ	10,200	700.00	7,140,000	
電通国際情報サービス	4,500	3,840.00	17,280,000	
デジタルガレージ	13,900	3,105.00	43,159,500	

EMシステムズ	7,200	1,172.00	8,438,400
ウェザーニューズ	3,000	3,215.00	9,645,000
C I J	9,000	753.00	6,777,000
WOWOW	3,600	3,320.00	11,952,000
スカラ	7,400	843.00	6,238,200
I M A G I C A G R O U P	7,400	607.00	4,491,800
ネットワンシステムズ	24,900	2,347.00	58,440,300
アルゴグラフィックス	3,100	4,540.00	14,074,000
マーベラス	12,200	917.00	11,187,400
エイベックス	12,300	1,545.00	19,003,500
日本ユニシス	21,800	2,895.00	63,111,000
兼松エレクトロニクス	3,900	3,640.00	14,196,000
東京放送ホールディングス	46,700	2,126.00	99,284,200
日本テレビホールディングス	64,400	1,777.00	114,438,800
朝日放送グループホールディングス	10,500	785.00	8,242,500
テレビ朝日ホールディングス	19,600	2,285.00	44,786,000
スカパーJ S A Tホールディングス	53,400	547.00	29,209,800
テレビ東京ホールディングス	5,800	2,750.00	15,950,000
ビジョン	2,300	4,775.00	10,982,500
コネクシオ	5,500	1,477.00	8,123,500
日本電信電話	479,100	4,680.00	2,242,188,000
K D D I	617,200	2,664.00	1,644,220,800
光通信	8,300	18,110.00	150,313,000
N T T ドコモ	503,000	2,628.50	1,322,135,500
エムティーアイ	10,200	601.00	6,130,200
G M O インターネット	25,900	1,490.00	38,591,000
カドカワ	20,600	1,411.00	29,066,600
学研ホールディングス	2,500	4,395.00	10,987,500
ゼンリン	14,100	2,817.00	39,719,700
アイネット	5,200	1,669.00	8,678,800
松竹	4,800	11,890.00	57,072,000
東宝	46,100	3,950.00	182,095,000
東映	2,900	13,800.00	40,020,000
エヌ・ティ・ティ・データ	186,500	1,320.00	246,180,000
D T S	7,700	4,090.00	31,493,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32,700	3,700.00	120,990,000



シーイーシー	7,700	2,455.00	18,903,500	
カブコン	30,500	2,222.00	67,771,000	
アイ・エス・ビー	1,700	2,374.00	4,035,800	
ジャステック	5,800	1,065.00	6,177,000	
S C S K	18,600	4,505.00	83,793,000	
日本システムウエア	2,800	2,474.00	6,927,200	
アイネス	10,100	1,269.00	12,816,900	
T K C	5,900	4,080.00	24,072,000	
富士ソフト	10,400	5,140.00	53,456,000	
N S D	11,200	2,392.00	26,790,400	
コナミホールディングス	28,700	5,080.00	145,796,000	
福井コンピュータホールディングス	3,000	1,755.00	5,265,000	
J B C C ホールディングス	6,600	1,771.00	11,688,600	
ミロク情報サービス	7,300	2,450.00	17,885,000	
ソフトバンクグループ	292,800	9,526.00	2,789,212,800	
伊藤忠食品	1,900	5,320.00	10,108,000	
エレマテック	3,800	2,261.00	8,591,800	
J A L U X	2,400	2,862.00	6,868,800	
あらた	4,000	4,930.00	19,720,000	
東京エレクトロン デバイス	3,800	1,911.00	7,261,800	
フィールズ	7,800	916.00	7,144,800	
双日	387,200	402.00	155,654,400	
アルフレッサ ホールディングス	77,800	3,020.00	234,956,000	
横浜冷凍	19,100	948.00	18,106,800	
アルコニックス	8,700	1,305.00	11,353,500	
神戸物産	10,600	3,480.00	36,888,000	
あい ホールディングス	11,500	2,263.00	26,024,500	
ダイワボウホールディングス	6,400	6,360.00	40,704,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	19,000	1,752.00	33,288,000	
ラクト・ジャパン	1,600	7,960.00	12,736,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,300	1,212.00	16,119,600	
八洲電機	9,000	835.00	7,515,000	
U K C ホールディングス	5,200	2,436.00	12,667,200	
ジューテックホールディングス	2,500	1,065.00	2,662,500	
T O K A I ホールディングス	36,700	1,004.00	36,846,800	
三洋貿易	4,400	2,023.00	8,901,200	

ウイン・パートナーズ	5,300	1,162.00	6,158,600
シップヘルスケアホールディングス	14,500	4,270.00	61,915,000
コメダホールディングス	16,600	2,370.00	39,342,000
小野建	7,100	1,678.00	11,913,800
佐島電機	6,600	1,051.00	6,936,600
伯東	5,700	1,339.00	7,632,300
コンドーテック	8,000	1,033.00	8,264,000
ナガイレーベン	10,400	2,775.00	28,860,000
三菱食品	7,500	3,065.00	22,987,500
松田産業	6,200	1,492.00	9,250,400
第一興商	10,700	5,180.00	55,426,000
メディパルホールディングス	75,600	2,600.00	196,560,000
S P K	2,000	2,390.00	4,780,000
萩原電気ホールディングス	3,200	3,205.00	10,256,000
アズワン	5,000	8,380.00	41,900,000
尾家産業	4,100	1,336.00	5,477,600
シモジマ	4,100	1,128.00	4,624,800
ドウシシャ	6,500	2,104.00	13,676,000
高速	6,500	1,209.00	7,858,500
丸文	9,000	847.00	7,623,000
ハビネット	6,300	1,615.00	10,174,500
日本ライフライン	22,100	1,798.00	39,735,800
エクセル	3,200	2,009.00	6,428,800
マルカキカイ	3,100	2,244.00	6,956,400
I D O M	25,400	570.00	14,478,000
日本エム・ディ・エム	4,800	1,389.00	6,667,200
進和	4,800	2,430.00	11,664,000
ダイトロン	3,900	1,540.00	6,006,000
シークス	9,200	1,808.00	16,633,600
オーハシテクニカ	5,700	1,398.00	7,968,600
白銅	3,500	1,772.00	6,202,000
伊藤忠商事	491,800	2,016.00	991,468,800
丸紅	693,900	847.50	588,080,250
長瀬産業	39,700	1,697.00	67,370,900
蝶理	5,400	1,894.00	10,227,600
豊田通商	77,800	3,920.00	304,976,000

三共生興	16,800	457.00	7,677,600
兼松	27,400	1,448.00	39,675,200
三井物産	579,100	1,774.50	1,027,612,950
日本紙パルプ商事	4,100	4,485.00	18,388,500
日立ハイテクノロジーズ	21,400	4,045.00	86,563,000
カメイ	9,900	1,385.00	13,711,500
スターゼン	2,700	4,390.00	11,853,000
山善	26,600	1,203.00	31,999,800
椿本興業	2,200	3,370.00	7,414,000
住友商事	415,900	1,743.50	725,121,650
内田洋行	3,900	2,701.00	10,533,900
三菱商事	493,200	3,062.00	1,510,178,400
第一実業	3,500	4,010.00	14,035,000
キヤノンマーケティングジャパン	20,400	2,178.00	44,431,200
西華産業	4,800	1,647.00	7,905,600
佐藤商事	8,000	996.00	7,968,000
菱洋エレクトロ	7,800	1,798.00	14,024,400
東京産業	9,400	595.00	5,593,000
ユアサ商事	7,000	3,805.00	26,635,000
神鋼商事	2,000	2,758.00	5,516,000
阪和興業	12,400	3,400.00	42,160,000
正栄食品工業	3,800	4,840.00	18,392,000
カナデン	8,200	1,309.00	10,733,800
菱電商事	6,900	1,600.00	11,040,000
フルサト工業	5,200	1,916.00	9,963,200
岩谷産業	15,800	3,780.00	59,724,000
極東貿易	3,000	1,767.00	5,301,000
イワキ	10,800	528.00	5,702,400
三愛石油	18,600	1,298.00	24,142,800
稲畑産業	16,300	1,628.00	26,536,400
ワキタ	15,700	1,305.00	20,488,500
東邦ホールディングス	20,900	3,015.00	63,013,500
サンゲツ	21,900	2,172.00	47,566,800
ミツウロコグループホールディングス	11,900	710.00	8,449,000
シナネンホールディングス	3,600	2,749.00	9,896,400
伊藤忠エネクス	14,800	1,067.00	15,791,600

サンリオ	22,500	2,346.00	52,785,000
サンワテクノス	5,700	1,247.00	7,107,900
リョーサン	8,200	3,310.00	27,142,000
新光商事	7,400	1,757.00	13,001,800
トーホー	4,100	2,395.00	9,819,500
三信電気	6,200	2,019.00	12,517,800
東陽テクニカ	11,000	908.00	9,988,000
モスフードサービス	8,900	3,065.00	27,278,500
加賀電子	7,000	2,404.00	16,828,000
ソーダニッカ	9,900	632.00	6,256,800
立花エレテック	6,100	1,769.00	10,790,900
PALTA C	12,500	6,080.00	76,000,000
太平洋興発	5,400	887.00	4,789,800
西本Wismettacホールディングス	1,700	5,180.00	8,806,000
ヤマタネ	4,800	1,959.00	9,403,200
日鉄住金物産	4,700	5,120.00	24,064,000
泉州電業	3,000	2,669.00	8,007,000
トラスコ中山	14,300	3,225.00	46,117,500
オートバックスセブン	28,500	1,736.00	49,476,000
モリト	7,400	813.00	6,016,200
加藤産業	10,600	3,515.00	37,259,000
イノテック	5,800	1,172.00	6,797,600
イエローハット	6,700	2,983.00	19,986,100
J Kホールディングス	10,000	615.00	6,150,000
日伝	6,600	1,828.00	12,064,800
杉本商事	4,800	1,800.00	8,640,000
因幡電機産業	9,600	4,715.00	45,264,000
パイテックホールディングス	3,000	2,432.00	7,296,000
東テク	2,800	2,810.00	7,868,000
ミスミグループ本社	88,000	2,572.00	226,336,000
タキヒヨー	3,400	1,967.00	6,687,800
スズケン	32,000	6,110.00	195,520,000
ジェコス	6,500	1,154.00	7,501,000
ローソン	17,800	7,430.00	132,254,000
サンエー	5,200	4,765.00	24,778,000
カワチ薬品	6,000	2,209.00	13,254,000

エービーシー・マート	11,000	6,380.00	70,180,000
アスクル	6,100	2,965.00	18,086,500
ゲオホールディングス	10,800	1,911.00	20,638,800
アダストリア	10,000	1,859.00	18,590,000
くらコーポレーション	4,200	7,140.00	29,988,000
キャンドウ	5,100	1,684.00	8,588,400
パルグループホールディングス	3,900	3,080.00	12,012,000
エディオン	29,300	1,248.00	36,566,400
サーラコーポレーション	16,600	661.00	10,972,600
ハローズ	3,100	2,598.00	8,053,800
あみやき亭	1,900	4,100.00	7,790,000
ひらまつ	19,600	369.00	7,232,400
大黒天物産	2,000	4,485.00	8,970,000
ハニーズホールディングス	8,800	909.00	7,999,200
アルペン	6,000	1,947.00	11,682,000
クオールホールディングス	10,500	2,030.00	21,315,000
ジーンズ	4,900	7,020.00	34,398,000
ビックカメラ	37,100	1,596.00	59,211,600
D C Mホールディングス	37,000	1,126.00	41,662,000
ペッパーフードサービス	5,700	4,100.00	23,370,000
Monotaro	44,800	3,075.00	137,760,000
DDホールディングス	2,000	2,466.00	4,932,000
アーランドサービスホールディングス	5,500	2,514.00	13,827,000
J.フロント リテイリング	90,100	1,550.00	139,655,000
ドトール・日レスホールディングス	12,100	2,215.00	26,801,500
マツモトキヨシホールディングス	29,100	4,215.00	122,656,500
ブロンコビリー	3,900	2,981.00	11,625,900
ZOZO	76,300	2,525.00	192,657,500
物語コーポレーション	2,100	11,070.00	23,247,000
ココカラファイン	7,800	6,480.00	50,544,000
三越伊勢丹ホールディングス	131,300	1,313.00	172,396,900
Hamee	2,200	1,831.00	4,028,200
ウエルシアホールディングス	18,500	5,750.00	106,375,000
クリエイトSDホールディングス	10,100	3,095.00	31,259,500
チムニー	2,800	2,751.00	7,702,800
シュッピン	5,300	1,095.00	5,803,500

ネクステージ	11,000	1,199.00	13,189,000	
ジョイフル本田	20,300	1,731.00	35,139,300	
鳥貴族	2,900	2,242.00	6,501,800	
キリン堂ホールディングス	3,400	1,615.00	5,491,000	
ホットランド	5,100	1,483.00	7,563,300	
すかいらーくホールディングス	65,800	1,860.00	122,388,000	
綿半ホールディングス	3,100	2,717.00	8,422,700	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	19,000	1,319.00	25,061,000	
あさひ	6,700	1,461.00	9,788,700	
日本調剤	2,700	3,670.00	9,909,000	
コスモス薬品	3,600	23,030.00	82,908,000	
セブン&アイ・ホールディングス	294,500	4,943.00	1,455,713,500	
薬王堂	3,100	3,400.00	10,540,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	18,800	1,325.00	24,910,000	
ツルハホールディングス	15,300	11,200.00	171,360,000	
サンマルクホールディングス	5,400	2,774.00	14,979,600	
トリドールホールディングス	8,900	2,212.00	19,686,800	
TOKYO BASE	7,300	696.00	5,080,800	
ジャパンミート	3,100	1,988.00	6,162,800	
ダイユー・リックホールディングス	5,000	1,191.00	5,955,000	
パロックジャパンリミテッド	6,900	1,073.00	7,403,700	
クスリのアオキホールディングス	5,500	8,400.00	46,200,000	
スシローグローバルホールディングス	7,800	6,220.00	48,516,000	
LIXILピバ	6,200	1,779.00	11,029,800	
メディカルシステムネットワーク	9,600	460.00	4,416,000	
ノジマ	12,400	2,605.00	32,302,000	
カッパ・クリエイト	11,200	1,500.00	16,800,000	
ライトオン	7,600	944.00	7,174,400	
良品計画	10,000	30,550.00	305,500,000	
三城ホールディングス	14,500	494.00	7,163,000	
アドヴァン	12,300	1,099.00	13,517,700	
アルピス	3,100	2,866.00	8,884,600	
コナカ	13,800	497.00	6,858,600	
G-7ホールディングス	2,600	2,636.00	6,853,600	
イオン北海道	10,100	812.00	8,201,200	

コジマ	12,800	518.00	6,630,400
コーナン商事	9,200	2,800.00	25,760,000
エコス	3,100	2,087.00	6,469,700
ワタミ	10,300	1,422.00	14,646,600
ドンキホーテホールディングス	45,600	6,890.00	314,184,000
西松屋チェーン	15,600	997.00	15,553,200
ゼンショーホールディングス	33,600	2,826.00	94,953,600
幸楽苑ホールディングス	6,200	2,241.00	13,894,200
サイゼリヤ	11,500	2,170.00	24,955,000
V Tホールディングス	26,000	469.00	12,194,000
ユナイテッドアローズ	8,100	3,825.00	30,982,500
ハイデイ日高	9,100	2,357.00	21,448,700
コロワイド	23,200	2,642.00	61,294,400
ピーシーデポコーポレーション	10,800	554.00	5,983,200
壱番屋	4,900	4,765.00	23,348,500
スギホールディングス	15,500	5,340.00	82,770,000
ヴィア・ホールディングス	11,800	731.00	8,625,800
スクロール	12,700	454.00	5,765,800
ヨンドシーホールディングス	7,900	2,465.00	19,473,500
ユニー・ファミリーマートホールディングス	19,600	16,110.00	315,756,000
木曽路	8,500	2,618.00	22,253,000
S R Sホールディングス	10,400	1,032.00	10,732,800
ケーヨー	17,000	609.00	10,353,000
上新電機	8,300	2,892.00	24,003,600
日本瓦斯	12,900	4,040.00	52,116,000
ロイヤルホールディングス	12,200	2,859.00	34,879,800
いなげや	7,700	1,582.00	12,181,400
島忠	16,100	3,065.00	49,346,500
チヨダ	7,300	2,049.00	14,957,700
ライフコーポレーション	5,200	2,708.00	14,081,600
リンガーハット	8,900	2,477.00	22,045,300
Mr Max HD	11,800	544.00	6,419,200
A O K Iホールディングス	13,800	1,465.00	20,217,000
オークワ	11,000	1,248.00	13,728,000
コメリ	11,300	2,717.00	30,702,100
青山商事	13,700	2,848.00	39,017,600

しまむら	8,200	9,640.00	79,048,000	
高島屋	55,400	1,650.00	91,410,000	
松屋	14,900	1,414.00	21,068,600	
エイチ・ツー・オー リテイリング	36,300	1,947.00	70,676,100	
近鉄百貨店	3,000	3,730.00	11,190,000	
パルコ	7,700	1,310.00	10,087,000	
丸井グループ	59,600	2,447.00	145,841,200	
アクシアル リテイリング	5,700	4,035.00	22,999,500	
イオン	270,500	2,721.00	736,030,500	
イズミ	14,300	6,430.00	91,949,000	
平和堂	13,800	3,150.00	43,470,000	
フジ	8,600	2,139.00	18,395,400	
ヤオコー	7,700	6,790.00	52,283,000	
ゼビオホールディングス	8,100	1,473.00	11,931,300	
ケーズホールディングス	73,200	1,197.00	87,620,400	
Olympicグループ	5,800	865.00	5,017,000	
日産東京販売ホールディングス	17,800	347.00	6,176,600	
Genky DrugStores	2,900	3,705.00	10,744,500	
総合メディカルホールディングス	6,100	2,665.00	16,256,500	
アインホールディングス	9,500	8,750.00	83,125,000	
元気寿司	2,100	5,010.00	10,521,000	
ヤマダ電機	215,500	549.00	118,309,500	
アークランドサカモト	11,900	1,552.00	18,468,800	
ニトリホールディングス	30,500	15,205.00	463,752,500	
グルメ杵屋	8,200	1,195.00	9,799,000	
吉野家ホールディングス	25,500	1,949.00	49,699,500	
松屋フーズホールディングス	3,300	3,895.00	12,853,500	
サガミホールディングス	10,400	1,382.00	14,372,800	
関西スーパーマーケット	6,900	1,100.00	7,590,000	
王将フードサービス	5,100	7,930.00	40,443,000	
プレナス	7,700	1,985.00	15,284,500	
ミニストップ	5,600	2,072.00	11,603,200	
アークス	12,800	2,844.00	36,403,200	
パローホールディングス	15,500	2,928.00	45,384,000	
ベルク	3,400	6,030.00	20,502,000	
大庄	5,500	1,718.00	9,449,000	



ファーストリテイリング	9,400	59,040.00	554,976,000	
サンドラッグ	26,400	3,830.00	101,112,000	
サックスパー ホールディングス	7,300	1,124.00	8,205,200	
ベルーナ	17,300	1,279.00	22,126,700	
じもとホールディングス	60,300	150.00	9,045,000	
めぶきフィナンシャルグループ	365,500	343.00	125,366,500	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	10,000	2,099.00	20,990,000	
九州フィナンシャルグループ	113,500	531.00	60,268,500	
ゆうちょ銀行	198,400	1,326.00	263,078,400	
富山第一銀行	21,600	433.00	9,352,800	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	446,200	533.00	237,824,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	45,900	1,232.00	56,548,800	
関西みらいフィナンシャルグループ	33,300	915.00	30,469,500	
三十三フィナンシャルグループ	7,000	1,919.00	13,433,000	
第四北越フィナンシャルグループ	12,200	3,700.00	45,140,000	
新生銀行	50,800	1,558.00	79,146,400	
あおぞら銀行	38,700	3,730.00	144,351,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,902,000	624.50	3,061,299,000	
りそなホールディングス	768,800	601.90	462,740,720	
三井住友トラスト・ホールディングス	137,600	4,552.00	626,355,200	
三井住友フィナンシャルグループ	495,800	4,183.00	2,073,931,400	
千葉銀行	247,000	745.00	184,015,000	
群馬銀行	138,400	541.00	74,874,400	
武蔵野銀行	10,600	3,070.00	32,542,000	
千葉興業銀行	23,600	445.00	10,502,000	
筑波銀行	36,800	242.00	8,905,600	
七十七銀行	21,900	2,273.00	49,778,700	
青森銀行	6,100	3,125.00	19,062,500	
秋田銀行	5,300	2,332.00	12,359,600	
山形銀行	8,200	2,387.00	19,573,400	
岩手銀行	5,100	4,140.00	21,114,000	
東邦銀行	63,400	376.00	23,838,400	
東北銀行	5,500	1,345.00	7,397,500	
みちのく銀行	5,500	1,817.00	9,993,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	56,700	2,589.00	146,796,300	
静岡銀行	175,700	1,019.00	179,038,300	

十六銀行	9,400	2,696.00	25,342,400	
スルガ銀行	69,800	538.00	37,552,400	
八十二銀行	122,900	521.00	64,030,900	
山梨中央銀行	9,300	1,663.00	15,465,900	
大垣共立銀行	11,000	2,490.00	27,390,000	
福井銀行	6,900	1,926.00	13,289,400	
北國銀行	7,800	4,250.00	33,150,000	
清水銀行	3,900	1,901.00	7,413,900	
富山銀行	1,700	3,780.00	6,426,000	
滋賀銀行	13,900	2,848.00	39,587,200	
南都銀行	8,600	2,574.00	22,136,400	
百五銀行	62,900	450.00	28,305,000	
京都銀行	25,000	5,460.00	136,500,000	
紀陽銀行	24,800	1,808.00	44,838,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	46,300	1,484.00	68,709,200	
広島銀行	101,800	684.00	69,631,200	
山陰合同銀行	42,000	895.00	37,590,000	
中国銀行	45,000	1,057.00	47,565,000	
伊予銀行	91,400	697.00	63,705,800	
百十四銀行	7,800	2,883.00	22,487,400	
四国銀行	11,100	1,399.00	15,528,900	
阿波銀行	11,100	3,280.00	36,408,000	
大分銀行	4,600	3,820.00	17,572,000	
宮崎銀行	5,200	3,285.00	17,082,000	
佐賀銀行	4,700	2,065.00	9,705,500	
十八銀行	4,600	2,853.00	13,123,800	
沖縄銀行	6,600	3,735.00	24,651,000	
琉球銀行	17,000	1,298.00	22,066,000	
セブン銀行	237,500	352.00	83,600,000	
みずほフィナンシャルグループ	9,556,000	188.30	1,799,394,800	
山口フィナンシャルグループ	86,600	1,176.00	101,841,600	
名古屋銀行	6,000	3,670.00	22,020,000	
北洋銀行	107,200	329.00	35,268,800	
愛知銀行	2,800	4,390.00	12,292,000	
中京銀行	3,700	2,355.00	8,713,500	
大光銀行	3,500	2,125.00	7,437,500	

愛媛銀行	11,000	1,155.00	12,705,000	
京葉銀行	31,000	800.00	24,800,000	
栃木銀行	39,200	295.00	11,564,000	
北日本銀行	3,000	2,484.00	7,452,000	
東和銀行	13,800	934.00	12,889,200	
福島銀行	10,000	564.00	5,640,000	
トモニホールディングス	57,000	473.00	26,961,000	
フィデアホールディングス	83,000	155.00	12,865,000	
池田泉州ホールディングス	77,800	338.00	26,296,400	
F P G	23,200	1,230.00	28,536,000	
S B Iホールディングス	83,800	2,576.00	215,868,800	
ジャフコ	11,700	4,150.00	48,555,000	
大和証券グループ本社	563,500	626.50	353,032,750	
野村ホールディングス	1,291,000	511.40	660,217,400	
岡三証券グループ	61,400	558.00	34,261,200	
丸三証券	23,000	894.00	20,562,000	
東洋証券	32,000	205.00	6,560,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	84,300	555.00	46,786,500	
水戸証券	24,000	307.00	7,368,000	
いちよし証券	16,000	957.00	15,312,000	
松井証券	34,500	1,286.00	44,367,000	
マネックスグループ	66,500	420.00	27,930,000	
カブドットコム証券	55,200	419.00	23,128,800	
極東証券	10,000	1,312.00	13,120,000	
岩井コスモホールディングス	8,000	1,411.00	11,288,000	
藍澤証券	15,400	765.00	11,781,000	
かんぽ生命保険	26,600	2,865.00	76,209,000	
S O M P Oホールディングス	137,900	4,386.00	604,829,400	
アニコムホールディングス	5,900	3,765.00	22,213,500	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	183,800	3,445.00	633,191,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	57,700	2,380.00	137,326,000	
第一生命ホールディングス	398,000	1,978.00	787,244,000	
東京海上ホールディングス	255,000	5,605.00	1,429,275,000	
T & Dホールディングス	216,900	1,613.00	349,859,700	
アドバンスクリエイト	4,000	2,057.00	8,228,000	

全国保証	20,200	3,880.00	78,376,000	
アルヒ	7,000	1,797.00	12,579,000	
クレディセゾン	49,400	1,457.00	71,975,800	
芙蓉総合リース	8,100	6,880.00	55,728,000	
興銀リース	13,700	2,800.00	38,360,000	
東京センチュリー	14,100	5,420.00	76,422,000	
日本証券金融	34,200	660.00	22,572,000	
アイフル	113,300	311.00	35,236,300	
リコーリース	5,800	3,695.00	21,431,000	
イオンフィナンシャルサービス	44,700	2,200.00	98,340,000	
アコム	142,300	417.00	59,339,100	
ジャックス	8,700	2,058.00	17,904,600	
オリエントコーポレーション	194,000	176.00	34,144,000	
日立キャピタル	16,700	2,805.00	46,843,500	
オリックス	469,500	1,839.50	863,645,250	
三菱UFJリース	158,200	619.00	97,925,800	
日本取引所グループ	190,200	2,045.00	388,959,000	
イー・ギャランティ	8,000	1,120.00	8,960,000	
NECキャピタルソリューション	3,300	1,686.00	5,563,800	
いちご	90,300	389.00	35,126,700	
日本駐車場開発	90,400	160.00	14,464,000	
ヒューリック	147,000	1,038.00	152,586,000	
三栄建築設計	3,600	1,575.00	5,670,000	
スター・マイカ	4,000	1,785.00	7,140,000	
野村不動産ホールディングス	46,800	2,242.00	104,925,600	
三重交通グループホールディングス	16,400	614.00	10,069,600	
サムティ	10,200	1,516.00	15,463,200	
ディア・ライフ	10,100	526.00	5,312,600	
日本商業開発	5,100	1,732.00	8,833,200	
プレサンスコーポレーション	11,400	1,416.00	16,142,400	
ユニゾホールディングス	11,000	2,312.00	25,432,000	
日本管理センター	5,800	1,019.00	5,910,200	
フージャースホールディングス	17,400	656.00	11,414,400	
オープンハウス	11,500	4,040.00	46,460,000	
東急不動産ホールディングス	189,100	637.00	120,456,700	
飯田グループホールディングス	58,700	2,003.00	117,576,100	

ムゲンエステート	6,500	691.00	4,491,500
ハウズドゥ	2,900	1,248.00	3,619,200
パーク24	41,300	3,065.00	126,584,500
パラカ	2,800	1,936.00	5,420,800
三井不動産	373,500	2,715.00	1,014,052,500
三菱地所	493,400	1,821.00	898,481,400
平和不動産	13,500	1,941.00	26,203,500
東京建物	77,500	1,294.00	100,285,000
ダイビル	20,700	1,242.00	25,709,400
京阪神ビルディング	15,000	912.00	13,680,000
住友不動産	158,400	4,208.00	666,547,200
大京	10,800	2,969.00	32,065,200
テオーシー	16,700	851.00	14,211,700
東京楽天地	1,800	4,845.00	8,721,000
レオパレス21	91,400	493.00	45,060,200
スターツコーポレーション	9,300	2,654.00	24,682,200
フジ住宅	11,800	907.00	10,702,600
空港施設	13,300	599.00	7,966,700
ゴールドクレスト	6,200	1,764.00	10,936,800
日本エスリード	4,200	1,621.00	6,808,200
日神不動産	13,500	513.00	6,925,500
日本エスコン	14,100	737.00	10,391,700
タカラレーベン	35,800	343.00	12,279,400
サンヨーハウジング名古屋	7,000	1,044.00	7,308,000
イオンモール	35,400	2,041.00	72,251,400
カチタス	8,000	3,265.00	26,120,000
トーセイ	10,800	1,029.00	11,113,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	44,000	1,679.00	73,876,000
サンフロンティア不動産	10,500	1,202.00	12,621,000
エフ・ジェー・ネクスト	8,200	944.00	7,740,800
日本空港ビルデング	22,600	4,410.00	99,666,000
日本工営	5,000	2,731.00	13,655,000
LIFULL	24,400	897.00	21,886,800
ジェイエイシーリクルートメント	5,900	2,315.00	13,658,500
日本M&Aセンター	51,300	2,647.00	135,791,100
タケエイ	9,900	866.00	8,573,400

トラスト・テック	3,400	3,260.00	11,084,000	
コシダカホールディングス	18,500	1,535.00	28,397,500	
パソナグループ	7,000	1,397.00	9,779,000	
リンクアンドモチベーション	12,900	1,041.00	13,428,900	
G C A	8,500	802.00	6,817,000	
エス・エム・エス	25,300	1,870.00	47,311,000	
パーソルホールディングス	68,300	2,126.00	145,205,800	
リニカル	4,400	1,616.00	7,110,400	
クックパッド	23,900	413.00	9,870,700	
学情	3,600	1,536.00	5,529,600	
スタジオアリス	3,800	2,598.00	9,872,400	
シミックホールディングス	4,400	2,177.00	9,578,800	
総合警備保障	27,100	5,340.00	144,714,000	
カカクコム	51,900	2,284.00	118,539,600	
アイロムグループ	3,100	2,193.00	6,798,300	
ルネサンス	4,300	2,372.00	10,199,600	
ディップ	10,900	2,550.00	27,795,000	
オプトホールディング	4,500	2,117.00	9,526,500	
新日本科学	11,600	711.00	8,247,600	
ツクイ	16,600	1,021.00	16,948,600	
エムスリー	143,900	1,834.00	263,912,600	
アウトソーシング	36,000	1,423.00	51,228,000	
ウェルネット	8,400	1,145.00	9,618,000	
ワールドホールディングス	2,200	2,736.00	6,019,200	
ディー・エヌ・エー	37,100	2,106.00	78,132,600	
博報堂D Yホールディングス	94,300	1,738.00	163,893,400	
ぐるなび	10,700	842.00	9,009,400	
エスアールジータカミヤ	9,400	695.00	6,533,000	
ジャパンベストレスキューシステム	6,300	1,624.00	10,231,200	
ファンコミュニケーションズ	20,200	705.00	14,241,000	
ライク	3,300	1,662.00	5,484,600	
W D Bホールディングス	3,400	2,878.00	9,785,200	
バリューコマース	5,000	1,486.00	7,430,000	
インフォマート	38,000	1,394.00	52,972,000	
J Pホールディングス	25,400	309.00	7,848,600	
E P Sホールディングス	10,400	2,185.00	22,724,000	

プレステージ・インターナショナル	13,400	1,441.00	19,309,400
アミューズ	4,300	2,737.00	11,769,100
ドリームインキュベータ	2,900	1,895.00	5,495,500
クイック	4,700	1,517.00	7,129,900
ケネディクス	64,900	535.00	34,721,500
電通	83,000	5,060.00	419,980,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	3,000	1,929.00	5,787,000
ぴあ	2,100	5,110.00	10,731,000
イオンファンタジー	2,300	3,170.00	7,291,000
シーティーエス	9,200	757.00	6,964,400
ネクシィーズグループ	2,400	1,803.00	4,327,200
みらかホールディングス	19,500	2,625.00	51,187,500
アルプス技研	6,100	2,098.00	12,797,800
日本空調サービス	9,600	761.00	7,305,600
オリエンタルランド	80,600	11,295.00	910,377,000
ダスキン	18,600	2,617.00	48,676,200
明光ネットワークジャパン	10,200	1,039.00	10,597,800
ファルコホールディングス	5,200	1,666.00	8,663,200
ラウンドワン	21,400	1,260.00	26,964,000
リゾートトラスト	29,500	1,867.00	55,076,500
ビー・エム・エル	8,800	2,885.00	25,388,000
りらいあコミュニケーションズ	12,100	1,061.00	12,838,100
リソー教育	36,300	390.00	14,157,000
ユー・エス・エス	83,400	2,014.00	167,967,600
サイバーエージェント	42,200	5,140.00	216,908,000
楽天	319,700	914.00	292,205,800
クリーク・アンド・リバー社	4,900	1,186.00	5,811,400
テー・オー・ダブリュー	8,300	896.00	7,436,800
セントラルスポーツ	2,900	3,790.00	10,991,000
フルキャストホールディングス	6,800	2,311.00	15,714,800
エン・ジャパン	7,600	4,580.00	34,808,000
テクノプロ・ホールディングス	13,000	5,680.00	73,840,000
Gunosy	4,400	3,380.00	14,872,000
イー・ガーディアン	3,600	2,675.00	9,630,000
ジャパンマテリアル	18,900	1,314.00	24,834,600
ベクトル	8,600	1,840.00	15,824,000

アサンテ	3,500	2,278.00	7,973,000
N・フィールド	5,000	1,154.00	5,770,000
バリューHR	2,200	2,074.00	4,562,800
M&Aキャピタルパートナーズ	1,800	4,265.00	7,677,000
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,700	1,572.00	5,816,400
アピスト	1,400	3,530.00	4,942,000
シグマクシス	4,400	1,076.00	4,734,400
ウィルグループ	5,400	1,181.00	6,377,400
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,500	465.00	5,347,500
リクルートホールディングス	488,700	3,123.00	1,526,210,100
エラン	2,600	3,000.00	7,800,000
日本郵政	556,700	1,382.00	769,359,400
ベルシステム24ホールディングス	11,600	1,507.00	17,481,200
鎌倉新書	5,400	1,254.00	6,771,600
LITALICO	2,000	1,910.00	3,820,000
エボラブルアジア	2,400	2,259.00	5,421,600
ストライク	1,900	2,929.00	5,565,100
ソラスト	17,000	1,436.00	24,412,000
インソース	2,500	2,471.00	6,177,500
キャリアインデックス	2,800	2,117.00	5,927,600
MS - Japan	3,200	1,562.00	4,998,400
グレイステクノロジー	2,000	2,151.00	4,302,000
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	4,500	2,125.00	9,562,500
日総工産	2,000	1,965.00	3,930,000
キュービーネットホールディングス	4,000	2,219.00	8,876,000
スプリックス	2,200	1,947.00	4,283,400
リログループ	37,400	3,120.00	116,688,000
東祥	4,300	4,230.00	18,189,000
エイチ・アイ・エス	12,000	3,825.00	45,900,000
共立メンテナンス	10,400	5,700.00	59,280,000
イチネンホールディングス	8,500	1,456.00	12,376,000
建設技術研究所	5,700	1,468.00	8,367,600
スペース	5,300	1,243.00	6,587,900
燦ホールディングス	2,300	2,576.00	5,924,800
東京テアトル	4,900	1,350.00	6,615,000



ナガワ	2,000	6,350.00	12,700,000	
よみうりランド	2,300	4,225.00	9,717,500	
東京都競馬	4,600	3,405.00	15,663,000	
常磐興産	5,300	1,757.00	9,312,100	
カナモト	9,700	3,340.00	32,398,000	
東京ドーム	25,800	1,039.00	26,806,200	
西尾レントオール	7,000	4,145.00	29,015,000	
トランス・コスモス	7,500	2,624.00	19,680,000	
乃村工藝社	15,900	3,045.00	48,415,500	
藤田観光	3,300	3,170.00	10,461,000	
KNT - CTホールディングス	4,300	1,288.00	5,538,400	
日本管財	7,000	2,089.00	14,623,000	
トーカイ	6,600	2,793.00	18,433,800	
セコム	72,400	9,606.00	695,474,400	
セントラル警備保障	3,400	6,340.00	21,556,000	
丹青社	13,200	1,290.00	17,028,000	
メイテック	8,900	5,120.00	45,568,000	
応用地質	8,300	1,338.00	11,105,400	
船井総研ホールディングス	14,100	2,095.00	29,539,500	
オオバ	7,800	732.00	5,709,600	
学究社	4,200	1,649.00	6,925,800	
ベネッセホールディングス	25,100	3,370.00	84,587,000	
イオンディライト	8,200	3,995.00	32,759,000	
ナック	6,000	1,097.00	6,582,000	
ニチイ学館	10,500	1,145.00	12,022,500	
ダイセキ	11,400	2,628.00	29,959,200	
合 計	81,162,800		168,579,248,010	

## (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

2018年12月28日現在

資産総額	24,204,693,535円
負債総額	68,847,286円
純資産総額（ - ）	24,135,846,249円
発行済口数	10,710,103,586口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2536円
（1万口当たり純資産額）	（22,536円）

### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

#### イ 名義書換

該当事項はありません。

#### ロ 受益者名簿

作成しません。

#### ハ 受益者に対する特典

ありません。

#### ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

##### （イ）受益権の譲渡

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

##### （ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

#### ホ 受益権の再分割

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

へ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### イ 資本金の額および株式数

	2018年12月28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	60,000,000株
発行済株式総数	17,640,000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。

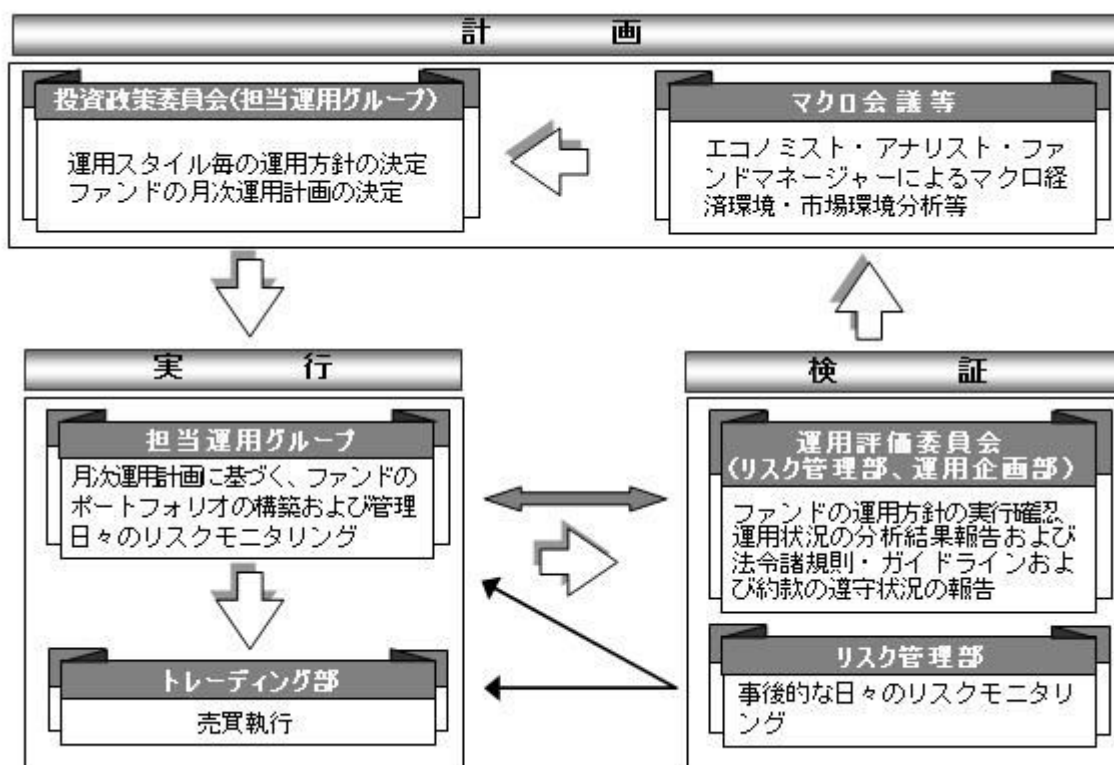
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

2018年12月28日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

	本数(本)	純資産総額(円)
追加型株式投資信託	460	5,571,176,784,447
単体型株式投資信託	91	431,508,495,114
追加型公社債投資信託	1	28,472,849,546
単体型公社債投資信託	112	295,752,952,848
合計	664	6,326,911,081,955

## 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33期（平成29年4月1日から平成30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34期中間会計期間（平成30年4月1日から平成30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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,279,384	20,873,870
顧客分別金信託	20,008	20,010
前払費用	351,526	402,249
未収入金	40,544	39,030
未収委託者報酬	5,511,715	6,332,203
未収運用受託報酬	1,297,104	1,725,215

未収投資助言報酬	343,523	316,407
未収収益	20,789	50,321
繰延税金資産	482,535	715,988
その他の流動資産	5,560	10,891
流動資産合計	21,352,691	30,486,188
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	198,767	185,371
器具備品	261,096	300,694
有形固定資産合計	459,864	486,065
無形固定資産		
ソフトウェア	493,806	409,765
ソフトウェア仮勘定	141,025	5,755
電話加入権	68	56
商標権	3	-
無形固定資産合計	634,903	415,576
投資その他の資産		
投資有価証券	12,098,372	10,616,594
関係会社株式	10,412,523	10,412,523
長期差入保証金	677,681	658,505
長期前払費用	61,282	69,423
会員権	7,819	7,819
繰延税金資産	871,577	678,459
投資その他の資産合計	24,129,257	22,443,325
固定資産合計	25,224,025	23,344,968
資産合計	46,576,717	53,831,157

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	304	84
その他の預り金	80,380	92,326
未払金		
未払収益分配金	655	649
未払償還金	140,124	137,522
未払手数料	2,424,318	2,783,763
その他未払金	52,903	236,739
未払費用	2,564,625	3,433,641
未払消費税等	160,571	547,706
未払法人税等	661,467	1,785,341
賞与引当金	1,001,068	1,507,256
その他の流動負債	445	1,408
流動負債合計	7,086,864	10,526,438
固定負債		
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830
賞与引当金	40,167	99,721
その他の固定負債	2,174	3,363
固定負債合計	3,219,473	3,422,915
負債合計	10,306,337	13,949,354

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	23,493,074	26,561,078
利益剰余金合計	25,314,279	28,382,283
株主資本計	35,943,263	39,011,267
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	327,116	870,535
評価・換算差額等合計	327,116	870,535
純資産合計	36,270,379	39,881,802
負債・純資産合計	46,576,717	53,831,157

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	31,628,014	36,538,981
運用受託報酬	5,649,190	8,362,118
投資助言報酬	1,726,511	1,440,233
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
サービス支援手数料	61,268	128,324
その他	54,261	55,820
営業収益計	39,124,246	46,530,479
営業費用		
支払手数料	14,908,517	16,961,384
広告宣伝費	366,227	353,971
公告費	1,140	1,140
調査費		
調査費	1,325,978	1,654,233
委託調査費	4,343,104	5,972,473
営業雑経費		
通信費	46,030	40,066
印刷費	338,254	339,048
協会費	21,669	-
諸会費	20,054	45,465
情報機器関連費	2,516,497	2,582,734
販売促進費	24,896	34,333
その他	149,177	136,669



営業費用合計		24,061,549	28,121,520
一般管理費			
給料			
役員報酬		225,885	196,529
給料・手当		6,121,741	6,190,716
賞与		610,533	601,375
賞与引当金繰入額		989,925	1,566,810
交際費		23,136	25,709
事務委託費		317,928	256,413
旅費交通費		229,248	220,569
租税公課		268,527	282,036
不動産賃借料		622,662	654,286
退職給付費用		423,954	419,884
固定資産減価償却費		384,068	329,756
諸経費		335,840	285,490
一般管理費合計		10,553,451	11,029,580
営業利益		4,509,246	7,379,378
営業外収益			
受取配当金	1	106,651	51,335
受取利息	1	745	520
時効成立分配金・償還金		1,721	2,622
原稿・講演料		1,474	894
雑収入		12,592	10,669
営業外収益合計		123,184	66,042
営業外費用			
為替差損		9,737	5,125
雑損失		1,084	913
営業外費用合計		10,821	6,038
経常利益		4,621,608	7,439,383
特別利益			
投資有価証券償還益		353,462	61,842
投資有価証券売却益		2,579	30,980
特別利益合計		356,041	92,822
特別損失			
固定資産除却損	2	8,157	354,695
投資有価証券償還損		43,644	141,666
投資有価証券売却損		15,012	9,634
ゴルフ会員権売却損		3,894	-
事務所移転費用		21,175	-
特別損失合計		91,884	505,996
税引前当期純利益		4,885,765	7,026,209
法人税、住民税及び事業税		1,391,996	2,350,891
法人税等調整額		25,454	280,166
法人税等合計		1,366,541	2,070,725
当期純利益		3,519,223	4,955,483

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 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			利益剰余金 合計	
					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
当期変動額									
剰余金の配当							2,010,960	2,010,960	2,010,960
当期純利益							3,519,223	3,519,223	3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,508,263	1,508,263	1,508,263
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263

	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
当期変動額			
剰余金の配当			2,010,960
当期純利益			3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	190,658	190,658	190,658
当期変動額合計	190,658	190,658	1,317,604
当期末残高	327,116	327,116	36,270,379

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本 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			利益剰余金 合計	
					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	23,493,074	25,314,279	35,943,263
当期変動額									
剰余金の配当							1,887,480	1,887,480	1,887,480
当期純利益							4,955,483	4,955,483	4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,068,003	3,068,003	3,068,003
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078	28,382,283	39,011,267

	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	327,116	327,116	36,270,379
当期変動額			

剰余金の配当			1,887,480
当期純利益			4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	870,535	870,535	39,881,802

## [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)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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	291,976千円	312,784千円
器具備品	651,918千円	768,929千円

2 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29年3月31日)	当事業年度 (平成30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
借入金未実行残高	-千円	-千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

3 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui 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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	256,031千円	204,923千円

(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28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
受取配当金	106,640千円	-千円
受取利息	18千円	-千円

2 固定資産除却損

	前事業年度 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	当事業年度 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	6,952千円	-千円
器具備品	1,204千円	0千円
ソフトウェア	-千円	9,000千円
ソフトウェア仮勘定	-千円	345,695千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成28年4月1日 至平成29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

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生在翌事業年度になるもの

平成29年6月27日開催の第32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29年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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29年6月27日 定時株主総会	普通株式	1,887,480	107,000	平成29年 3月31日	平成29年 6月28日

## (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生在翌事業年度になるもの

平成30年6月26日開催の第33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30年6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000	平成30年 3月31日	平成30年 6月27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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
1年以内	626,698	208,187
1年超	191,491	42,916
合計	818,190	251,104

## (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29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	13,279,384	13,279,384	-
(2)顧客分別金信託	20,008	20,008	-
(3)未収委託者報酬	5,511,715	5,511,715	-
(4)未収運用受託報酬	1,297,104	1,297,104	-
(5)未収投資助言報酬	343,523	343,523	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	12,098,074	12,098,074	-
(7)長期差入保証金	677,681	677,681	-
資産計	33,227,492	33,227,492	-
(1)顧客からの預り金	304	304	-
(2)未払手数料	2,424,318	2,424,318	-
負債計	2,424,622	2,424,622	-

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	20,873,870	20,873,870	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	6,332,203	6,332,203	-
(4)未収運用受託報酬	1,725,215	1,725,215	-
(5)未収投資助言報酬	316,407	316,407	-
(6)投資有価証券			
其他有価証券	10,616,296	10,616,296	-
(7)長期差入保証金	658,505	658,505	-
資産計	40,542,507	40,542,507	-
(1)顧客からの預り金	84	84	-
(2)未払手数料	2,783,763	2,783,763	-
負債計	2,783,847	2,783,847	-

(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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
其他有価証券 非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	10,412,523	10,412,523
合計	10,412,523	10,412,523

其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)其他有価証券」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29年3月31日）

（単位：千円）

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
----	------	---------	----------	------

現金及び預金	13,279,384	-	-	-
顧客分別金信託	20,008	-	-	-
未収委託者報酬	5,511,715	-	-	-
未収運用受託報酬	1,297,104	-	-	-
未収投資助言報酬	343,523	-	-	-
長期差入保証金	31,201	646,480	-	-
合計	20,482,937	646,480	-	-

当事業年度（平成30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	20,873,870	-	-	-
顧客分別金信託	20,010	-	-	-
未収委託者報酬	6,332,203	-	-	-
未収運用受託報酬	1,725,215	-	-	-
未収投資助言報酬	316,407	-	-	-
長期差入保証金	602,360	56,144	-	-
合計	29,870,067	56,144	-	-

（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29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。

当事業年度（平成30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29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	4,921,829	4,267,927	653,902
小計	4,921,829	4,267,927	653,902
(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	7,176,244	7,358,662	182,417
小計	7,176,244	7,358,662	182,417
合計	12,098,074	11,626,589	471,485

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

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(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	7,366,669	6,046,232	1,320,437
小計	7,366,669	6,046,232	1,320,437
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,249,626	3,315,328	65,701



小計	3,249,626	3,315,328	65,701
合計	10,616,296	9,361,560	1,254,735

(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. 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28年4月1日 至 平成29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
228,204	2,579	15,012

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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
532,099	30,980	9,634

(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28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,028,212	3,177,131
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の発生額	15,494	51,212
退職給付の支払額	116,111	94,727
退職給付債務の期末残高	3,177,131	3,319,830

##### (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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	3,177,131	3,319,830
未認識数理計算上の差異	-	-
未認識過去勤務費用	-	-
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830

##### (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28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
勤務費用	280,524	285,715
利息費用	-	2,922
数理計算上の差異の費用処理額	15,494	51,212
その他	158,924	182,458
確定給付制度に係る退職給付費用	423,954	419,884

(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	当事業年度
	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
割引率	0.092%	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137,310千円、当事業年度147,195千円であります。

#### (税効果会計関係)

##### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位:千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	308,929	461,521
調査費	79,381	90,509
未払金	45,745	59,821
未払事業税	46,406	102,103
その他	2,071	2,032
繰延税金資産合計	482,535	715,988
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	972,837	1,016,532
ソフトウェア償却	18,718	11,289
賞与引当金	12,299	30,534
投資有価証券評価損	95	95
その他	14,592	6,805
繰延税金資産小計	1,018,544	1,065,256
評価性引当額	2,597	2,597
繰延税金資産合計	1,015,946	1,062,659
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	144,368	384,200
繰延税金負債合計	144,368	384,200
繰延税金資産の純額	1,354,113	1,394,447

##### 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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
法定実効税率	30.8%	30.8%
(調整)		
評価性引当額の増減	0.1	-
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.2
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.8	-
住民税均等割等	0.1	0.1
所得税額控除による税額控除	2.2	1.9
その他	0.0	0.1
税効果会計適用後の法人税等の負担率	27.9	29.4

(セグメント情報等)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	31,628,014	5,649,190	1,726,511	120,529	39,124,246

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

## 1.セグメント情報

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

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

## 2.関連情報

### (1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への営業収益	36,538,981	8,362,118	1,440,233	189,145	46,530,479

### (2)地域ごとの情報

#### 営業収益

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

#### 有形固定資産

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

### (3)主要な顧客ごとの情報

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

## 3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

## 4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

## 5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

### 1. 関連当事者との取引

#### (1)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	SumitomoMitsui AssetManagement (HongKong)Limited	Hong Kong	5,000,000 (ホンコン ドル)	投資運 用業	% (所有) 直接100	投言の助 言業務 役員の 兼任	剰余金 の配当	106,640	-	-

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等  
受取配当金については、剰余金の分配可能額を基礎とした一定の基準に基づき合理的に決定しております。

#### (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
親会社 の子会 社	㈱三井住友 銀行	東京都千 代田区	1,770,996,505	銀行業	-	投信の販売 委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,737,677	未払 手数料	489,567
親会社 の子会 社	SMBC日興証 券㈱	東京都千 代田区	10,000,000	証券業	-	投信の販売 委託	委託販売 手数料	5,485,934	未払 手数料	862,697

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

3. ㈱三井住友銀行の属性が、平成28年7月29日付けで、「その他の関係会社」より「親会社」、平成28年10月1日付けで「親会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社」及び「親会社」であった期間の取引金額が含まれております。

4. SMBC日興証券㈱の属性が、平成28年10月1日付けで、「その他の関係会社の子会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社の子会社」であった期間の取引金額が含まれております。

## 2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

### 1. 関連当事者との取引

#### (1) 兄弟会社等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資 金 又は基金	事業の 内容又は 職業	議決権等 の所有(被 所有)割合	関連当事 者との関 係	取引の内 容	取引金額	科目	期末残高
親会社 の子会 社	㈱三井住友 銀行	東京都 千代田 区	1,770,996,505	銀行業	-	投信の販売 委託 役員の兼任	委託販売 手数料	2,761,066	未払 手数料	429,436
親会社 の子会 社	SMBC日興証 券㈱	東京都 千代田 区	10,000,000	証券業	-	投信の販売 委託 役員の 兼任	委託販売 手数料	5,685,815	未払 手数料	953,752

(注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## 2. 親会社に関する注記

株式会社三井住友フィナンシャルグループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場）

### (1 株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	2,056,143.98円	2,260,873.18円
1株当たり当期純利益金額	199,502.47円	280,923.11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28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	3,519,223	4,955,483
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)	3,519,223	4,955,483

期中平均株式数(株)	17,640	17,640
------------	--------	--------

## (重要な後発事象)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する主要株主間での基本合意について

平成30年5月11日付で当社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主である株式会社三井住友フィナンシャルグループ、株式会社大和証券グループ本社、三井住友海上火災保険株式会社及び住友生命保険相互会社が、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結しました。

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第34期中間会計期間 (平成30年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		19,085,678
顧客分別金信託		20,010
前払費用		414,616
未収委託者報酬		7,225,367
未収運用受託報酬		1,541,190
未収投資助言報酬		306,565
未収収益		51,614
その他		53,465
流動資産合計		28,698,508
固定資産		
有形固定資産	1	508,186
無形固定資産		437,397
投資その他の資産		
投資有価証券		9,519,317
関係会社株式		10,412,523
繰延税金資産		1,364,662
その他		1,500,406
投資その他の資産合計		22,796,910
固定資産合計		23,742,493
資産合計		52,441,002
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		649
その他の預り金		116,730
未払金		3,491,463
未払費用		3,428,351

未払法人税等		1,080,277
前受収益		8,509
賞与引当金		1,233,571
その他	2	228,340
流動負債合計		9,587,893
固定負債		
退職給付引当金		3,435,254
賞与引当金		41,631
その他		1,383
固定負債合計		3,478,268
負債合計		13,066,162
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		26,222,740
利益剰余金合計		28,043,944
株主資本合計		38,672,928
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		701,911
評価・換算差額等合計		701,911
純資産合計		39,374,840
負債純資産合計		52,441,002

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第34期中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		20,003,107
運用受託報酬		3,216,910
投資助言報酬		696,543
その他の営業収益		117,677
営業収益計		24,034,239
営業費用		15,495,987
一般管理費	1	5,200,633

営業利益		3,337,618
営業外収益	2	13,622
営業外費用	3	10,296
経常利益		3,340,944
特別利益	4	293,441
特別損失	5	35,355
税引前中間純利益		3,599,031
法人税、住民税及び事業税		1,010,764
法人税等調整額		104,205
法人税等合計		1,114,969
中間純利益		2,484,061

## (3)中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30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		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
					配当準備積立金	別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078	28,382,283	39,011,267
当中間期変動額									
剰余金の配当							2,822,400	2,822,400	2,822,400
中間純利益							2,484,061	2,484,061	2,484,061
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	338,338	338,338	338,338
当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,222,740	28,043,944	38,672,928

	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	870,535	870,535	39,881,802
当中間期変動額			
剰余金の配当			2,822,400
中間純利益			2,484,061
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	168,624	168,624	168,624
当中間期変動額合計	168,624	168,624	506,962
当中間期末残高	701,911	701,911	39,374,840

## 注記事項

## （重要な会計方針）

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1)有価証券

子会社株式及び関連会社株式

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。

（表示方法の変更）

「税効果会計に係る会計基準」の一部改正（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

（中間貸借対照表関係）

第34期中間会計期間 (平成30年9月30日)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	1,162,157千円
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、金額の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198,989千円の支払保証を行っております。	

（中間損益計算書関係）

第34期中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)	
1. 減価償却実施額	
有形固定資産	80,772千円
無形固定資産	84,457千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
雑益	13,281千円
3. 営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	10,293千円
4. 特別利益のうち主要なもの	
投資有価証券償還益	289,451千円
投資有価証券売却益	3,990千円
5. 特別損失のうち主要なもの	
合併関連費用	23,103千円
合併関連費用は、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する業務委託費用等であり	
ます。	
投資有価証券売却損	12,101千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30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30年6月26日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000	平成30年 3月31日	平成30年 6月27日

## (リース取引関係)

第34期中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30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	595,231千円
1年超	3,853,814千円
合 計	4,449,045千円

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第34期中間会計期間(平成30年9月30日)

平成30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	19,085,678	19,085,678	-
(2)顧客分別金信託	20,010	20,010	-
(3)未収委託者報酬	7,225,367	7,225,367	-
(4)未収運用受託報酬	1,541,190	1,541,190	-
(5)未収投資助言報酬	306,565	306,565	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	9,519,019	9,519,019	-
(7)投資その他の資産			
長期差入保証金	1,434,365	1,434,365	-
資産計	39,132,197	39,132,197	-

(1)顧客からの預り金	649	649	-
(2)未払金 未払手数料	3,310,988	3,310,988	-
負債計	3,311,637	3,311,637	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## 資 産

(1)現金及び預金、(2)顧客分別金信託、(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬、及び(5)未収投資助言報酬  
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

## (6)投資有価証券

## その他有価証券

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

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

## (7)投資その他の資産

## 長期差入保証金

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

## 負 債

## (1)顧客からの預り金、及び(2)未払金 未払手数料

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

## (注2) 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)

区分	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34期中間会計期間（平成30年9月30日）

## 1. 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。

## 2. 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	6,621,299	5,533,700	1,087,599
小計	6,621,299	5,533,700	1,087,599
(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	2,897,719	2,973,628	75,908
小計	2,897,719	2,973,628	75,908
合計	9,519,019	8,507,328	1,011,691

(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34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への 営業収益	20,003,107	3,216,910	696,543	117,677	24,034,239

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

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）

<p>第34期中間会計期間 （自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）</p>
--

1株当たり純資産額	2,232円13銭
1株当たり中間純利益	140円81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いません。</p>	
<p>(注)当社は、平成30年11月1日付で普通株式1株につき1,000株の割合で株式分割を行っております。これに伴い、当事業年度の期首に当該株式分割が行われたと仮定して、1株当たり純資産額及び1株当たり中間純利益を算定しております。</p>	
<p>1株当たり純資産額の算定上の基礎</p>	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	39,374,840千円
普通株式に係る純資産額	39,374,840千円
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	17,640,000株
<p>1株当たり中間純利益の算定上の基礎</p>	
中間損益計算書上の中間純利益	2,484,061千円
普通株式に係る中間純利益	2,484,061千円
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
1株当たり中間純利益の算定に用いられた普通株式の期中平均株式数	17,640,000株

## (追加情報)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間での合併契約の締結について

当社は、平成30年9月28日開催の当社取締役会において、当社と大和住銀投信投資顧問株式会社(以下「大和住銀」)との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結しました。また、平成30年10月31日に当社臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ております。

## 1. 企業結合の概要

## (1)被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称	大和住銀投信投資顧問株式会社
事業の内容	投資運用業、投資助言・代理業等

## (2)企業結合を行う主な理由

資産運用ビジネスはグローバルに成長拡大しており、お客さまから求められる運用力やサービスはますます高度化しております。本件合併は、このようなお客さまからのニーズに対応するために、両運用会社の持つ強み・ノウハウを結集した、フィデューシャリー・デューティーに基づく最高品質の運用パフォーマンスとサービスを提供する資産運用会社の実現を図るものであります。

## (3)企業結合日

平成31年4月1日(予定)

## (4)企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀を消滅会社とする吸収合併方式であります。

## (5)結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

## (6)取得企業を決定するに至った主な根拠

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)の考え方に基づき、当社を取得企業としております。

## 2. 合併比率及びその算定方法並びに交付予定の株式数

## (1) 合併比率

大和住銀の普通株式 1 株に対し、当社の普通株式4.2156株を割当て交付いたします。

## (2) 合併比率の算定方法

当社はE Yトランザクション・アドバイザー・サービス株式会社を、大和住銀はP w Cアドバイザー合同会社を、合併比率の算定に関する第三者算定機関としてそれぞれ選定し、各第三者算定機関による算定結果を参考に、両社の財務の状況、資産の状況、将来の見通し等の要因を総合的に勘案し、合併比率について慎重に協議を重ねた結果、合併比率が妥当であるとの判断し、合意に至ったものであります。

## (3) 交付予定の株式数

普通株式：16,230,060株

## (重要な後発事象)

## 株式分割

当社は、平成30年9月28日開催の取締役会決議に基づき、平成30年11月1日付で株式分割を行っております。

## 1. 株式分割の目的

合併に伴い株主の議決権割合が変更となる見込みであり、円滑に変更手続きを行うために株式分割を行っております。

## 2. 株式分割の概要

## (1) 分割の方法

平成30年10月31日を基準日として、同日最終の株主名簿に記載された株主の所有する普通株式 1 株につき、1,000株の割合をもって分割しております。

## (2) 分割により増加した株式数

株式分割前の発行済株式総数	17,640株
今回の分割により増加した株式数	17,622,360株
株式分割後の発行済株式数	17,640,000株
株式分割後の発行可能株式総数	60,000,000株

## (3) 株式分割の日程

基準日公告日	平成30年10月12日
基準日	平成30年10月31日
効力発生日	平成30年11月1日

## (4) 1株当たり情報に及ぼす影響

1株当たり情報に及ぼす影響については、当該箇所に記載しております。

## 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 上記八、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

### イ 定款の変更、その他の重要事項

(イ) 三井住友アセットマネジメント株式会社は、関係当局の認可等を得ることを前提に、2019年4月1日に大和住銀投信投資顧問株式会社と合併し、商号を三井住友D Sアセットマネジメント株式会社に変更する予定です。

(ロ) 2018年11月1日付で、発行可能株式総数を変更する定款の変更を行いました。

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(2018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(2018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	
野村証券株式会社	10,000百万円	
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595百万円	保険業法に基づき、損害保険業を営んでいます。
住友生命保険相互会社	639,000百万円	保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。
三井生命保険株式会社	167,280百万円	

資本金の額は、2018年9月末現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額の箇所には、基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

## 2【関係業務の概要】

### イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

### ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書(目論見書)の提供、一部解約の実行の請求の受付け、収益分配金、償還金の支払事務等を行います。

## 3【資本関係】

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3,528,000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3,528,000株(持株比率20.0%)保有しています。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2018年 2月22日	有価証券届出書
2018年 2月22日	有価証券報告書
2018年 8月28日	有価証券届出書
2018年 8月28日	半期報告書



**独立監査人の監査報告書**

平成30年6月14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29年4月1日から平成30年3月31日までの第33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30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、平成30年5月11日付で会社及び大和住銀投信投資顧問株式会社の主要株主が、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社との合併に関する基本合意書を締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注)1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。2. XBR 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31年1月8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	菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・日本株式インデックス年金ファンドの平成29年12月1日から平成30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30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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

平成30年11月22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 菅野 雅子 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「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30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30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30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30年4月1日から平成30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。

**強調事項**

追加情報に記載されているとおり、会社は、平成30年9月28日開催の会社の取締役会において、会社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間で合併契約を締結することについて決議し、同日付で締結した。また、平成30年10月31日に会社の臨時株主総会において当該合併契約の承認を得ている。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

**利害関係**

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は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。