

【表紙】

【提出書類】	半期報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成30年8月28日提出
【計算期間】	第10期中(自 平成29年12月1日至 平成30年5月31日)
【ファンド名】	外国株式指数ファンド
【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。

1【ファンドの運用状況】

(1)【投資状況】

外国株式指数ファンド

2018年 6月29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	1,644,918,172	100.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		736,634	0.04
合計(純資産総額)		1,644,181,538	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。以下同じ。

(2)【運用実績】

【純資産の推移】

外国株式指数ファンド

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9期 (2017年11月30日)	1,467,173,818	1,467,173,818	25,629	25,629
2017年 6月末日	1,295,643,870		23,729	
7月末日	1,339,319,256		23,898	
8月末日	1,353,130,271		23,797	
9月末日	1,405,344,125		24,898	
10月末日	1,442,685,918		25,466	
11月末日	1,467,173,818		25,629	
12月末日	1,522,433,766		26,414	
2018年 1月末日	1,570,368,917		26,701	
2月末日	1,538,114,551		25,491	
3月末日	1,520,710,312		24,394	
4月末日	1,609,458,451		25,478	
5月末日	1,613,938,926		25,594	
6月末日	1,644,181,538		25,789	

【分配の推移】

外国株式指数ファンド

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第9期	2016年12月 1日～2017年11月30日	0

【収益率の推移】

外国株式指数ファンド

	収益率（％）
第9期	22.1
第10期（中間期）	0.1

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配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。

（参考）

（１）投資状況

外国株式インデックス・マザーファンド

2018年 6月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 （円）	投資比率 （％）
株式	アメリカ	109,515,374,545	60.33
	イギリス	11,659,611,676	6.42
	フランス	6,686,643,386	3.68
	カナダ	6,663,344,224	3.67
	ドイツ	6,459,143,223	3.56
	スイス	5,783,463,548	3.19
	オーストラリア	4,216,576,507	2.32
	オランダ	3,350,551,977	1.85
	アイルランド	2,550,195,379	1.40
	スペイン	2,090,015,477	1.15
	スウェーデン	1,718,623,403	0.95
	香港	1,664,460,699	0.92
	イタリア	1,340,070,552	0.74
	デンマーク	1,125,243,670	0.62
	ジャージー	937,445,711	0.52
バミューダ	841,119,248	0.46	

	シンガポール	826,717,068	0.46
	ベルギー	734,530,988	0.40
	フィンランド	703,824,589	0.39
	ノルウェー	509,177,532	0.28
	キュラソー	445,963,025	0.25
	ケイマン諸島	442,654,004	0.24
	イスラエル	364,554,040	0.20
	ルクセンブルグ	237,874,555	0.13
	オーストリア	168,049,605	0.09
	ニュージーランド	147,247,815	0.08
	ポルトガル	113,295,741	0.06
	リベリア	85,965,911	0.05
	英ヴァージン諸島	52,959,581	0.03
	南アフリカ	49,911,148	0.03
	パプアニューギニア	43,768,815	0.02
	マン島	35,852,074	0.02
	モーリシャス	8,855,877	0.00
	小計	171,573,085,593	94.52
投資証券	アメリカ	2,878,537,565	1.59
	オーストラリア	500,234,804	0.28
	フランス	250,156,068	0.14
	イギリス	151,323,658	0.08
	香港	118,590,175	0.07
	シンガポール	75,255,804	0.04
	カナダ	36,424,275	0.02
	小計	4,010,522,349	2.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,935,012,713	3.27
合計(純資産総額)		181,518,620,655	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	アメリカ	4,178,528,067	2.30
	買建	ドイツ	1,058,707,232	0.58
	買建	イギリス	414,883,654	0.22

	買建	オーストラリア	288,028,724	0.15
合計	買建		5,940,147,677	3.25

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		308,490,100	0.16

2【設定及び解約の実績】

外国株式指数ファンド

	設定口数（口）	解約口数（口）
第9期	147,862,778	164,312,140
第10期（中間期）	109,690,312	51,576,553

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)ならびに同規則第38条の3、第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第10期中間計算期間（平成29年12月1日から平成30年5月31日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

【外国株式指数ファンド】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (平成29年11月30日現在)	第10期中間計算期間 (平成30年5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	92,307	1,837,560
コール・ローン	2,173,574	55,421
親投資信託受益証券	1,470,932,343	1,613,957,728
未収入金	-	3,338,143
流動資産合計	1,473,198,224	1,619,188,852
資産合計	1,473,198,224	1,619,188,852
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,261,190	5,226,039
未払受託者報酬	446,243	2,829
未払委託者報酬	3,272,368	20,747
未払利息	6	-
その他未払費用	44,599	311
流動負債合計	6,024,406	5,249,926
負債合計	6,024,406	5,249,926
純資産の部		
元本等		
元本	572,474,064	630,587,823
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	894,699,754	983,351,103
元本等合計	1,467,173,818	1,613,938,926
純資産合計	1,467,173,818	1,613,938,926
負債純資産合計	1,473,198,224	1,619,188,852

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期中間計算期間 自 平成28年12月 1日 至 平成29年 5月31日	第10期中間計算期間 自 平成29年12月 1日 至 平成30年 5月31日
営業収益		
有価証券売買等損益	137,497,509	2,476,834
営業収益合計	137,497,509	2,476,834
営業費用		
支払利息	519	496
受託者報酬	401,774	501,145
委託者報酬	2,946,233	3,674,994
その他費用	40,188	50,142
営業費用合計	3,388,714	4,226,777
営業利益又は営業損失()	134,108,795	1,749,943
経常利益又は経常損失()	134,108,795	1,749,943
中間純利益又は中間純損失()	134,108,795	1,749,943
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	15,850,006	1,523,846
期首剰余金又は期首欠損金()	647,406,729	894,699,754
剰余金増加額又は欠損金減少額	72,412,358	172,302,708
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	72,412,358	172,302,708
剰余金減少額又は欠損金増加額	120,649,809	80,377,570
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	120,649,809	80,377,570
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	717,428,067	983,351,103

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第10期中間計算期間 自 平成29年12月 1日 至 平成30年 5月31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>

(中間貸借対照表に関する注記)

項 目	第9期 (平成29年11月30日現在)	第10期中間計算期間 (平成30年 5月31日現在)
1. 当中間計算期間の末日における受益権の総数	572,474,064口	630,587,823口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.5629円 (10,000口当たりの純資産額 25,629円)	1口当たり純資産額 2.5594円 (10,000口当たりの純資産額 25,594円)

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	第10期中間計算期間 (平成30年 5月31日現在)	
	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(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。 (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。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第9期	第10期中間計算期間
	(平成29年11月30日現在)	(平成30年 5月31日現在)
期首元本額	588,923,426円	572,474,064円
期中追加設定元本額	147,862,778円	109,690,312円
期中一部解約元本額	164,312,140円	51,576,553円

（参考）

外国株式指数ファンドは、「外国株式インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間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。

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

	(単位：円)	
	(平成29年11月30日現在)	(平成30年 5月31日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,045,446,006	2,928,705,286
金銭信託	40,820,614	582,194,770
コール・ローン	961,214,692	17,559,176
株式	186,748,057,204	171,410,296,577
投資証券	4,575,745,028	3,870,769,399

	（平成29年11月30日現在）	（平成30年 5月31日現在）
派生商品評価勘定	62,785,042	70,902,114
未収入金	824,199	70,056,120
未収配当金	330,350,949	414,721,567
差入委託証拠金	2,084,414,395	2,236,816,914
流動資産合計	196,849,658,129	181,602,021,923
資産合計	196,849,658,129	181,602,021,923
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	27,086,108	26,347,550
前受金	34,765,634	43,535,064
未払解約金	605,716,214	379,712,277
未払利息	2,817	51
その他未払費用	18,059	21,269
流動負債合計	667,588,832	449,616,211
負債合計	667,588,832	449,616,211
純資産の部		
元本等		
元本	58,029,292,656	53,508,943,444
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	138,152,776,641	127,643,462,268
元本等合計	196,182,069,297	181,152,405,712
純資産合計	196,182,069,297	181,152,405,712
負債純資産合計	196,849,658,129	181,602,021,923

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5月31日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資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>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算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> <p>(2) 為替予約取引</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、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(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 5月31日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	58,029,292,656口	53,508,943,444口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 3.3807円 (10,000口当たりの純資産額 33,807円)	1口当たり純資産額 3.3855円 (10,000口当たりの純資産額 33,855円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 5月31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	(1) 有価証券(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (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。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(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				

市場取引以外 の取引	買建	4,797,588,348	-	4,832,353,982	34,765,634
	SPMINI 1712	3,280,301,567	-	3,338,516,864	58,215,297
	DJ EUR 1712	942,896,548	-	919,431,677	23,464,871
	FTSE 1712	347,386,322	-	344,530,803	2,855,519
	SPI200 1712	227,003,911	-	229,874,638	2,870,727
	為替予約取引				
	買建	224,489,300	-	225,422,600	933,300
	米ドル	167,400,000	-	168,060,000	660,000
	カナダドル	3,482,000	-	3,483,600	1,600
	ユーロ	31,740,000	-	31,874,400	134,400
	英ポンド	14,916,000	-	15,032,000	116,000
	スイスフラン	3,401,400	-	3,414,900	13,500
	スウェーデンク ローナ	1,337,000	-	1,338,000	1,000
	ノルウェークロー ネ	135,600	-	135,700	100
	デンマーククロー ネ	533,100	-	535,200	2,100
	香港ドル	715,000	-	717,000	2,000
	シンガポールドル	829,200	-	831,800	2,600
	合計	5,022,077,648	-	5,057,776,582	35,698,934

(平成30年 5月31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	5,839,990,321	-	5,883,525,385	43,535,064
	SPMINI 1806	4,057,609,309	-	4,116,679,878	59,070,569
	DJ EUR 1806	1,082,565,679	-	1,062,491,647	20,074,032
	FTSE 1806	414,260,532	-	420,483,117	6,222,585
	SPI200 1806	285,554,801	-	283,870,743	1,684,058
市場取引以外 の取引	為替予約取引				
	買建	162,500,500	-	163,520,000	1,019,500
	米ドル	92,148,500	-	92,386,500	238,000
	カナダドル	4,161,000	-	4,217,000	56,000

ユーロ	37,521,000	-	38,019,000	498,000
英ポンド	14,367,000	-	14,455,000	88,000
スイスフラン	5,467,000	-	5,502,500	35,500
スウェーデンク ローナ	1,208,000	-	1,233,000	25,000
ノルウェークロー ネ	654,000	-	662,500	8,500
デンマーククロー ネ	840,500	-	851,500	11,000
オーストラリアド ル	4,060,500	-	4,117,000	56,500
香港ドル	2,073,000	-	2,076,000	3,000
合計	6,002,490,821	-	6,047,045,385	44,554,564

(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) 為替予約取引の時価の算定方法について

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。

2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

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。

(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	60,085,742,502円
同期中における追加設定元本額	23,767,291,622円
同期中における一部解約元本額	25,823,741,468円

平成29年11月30日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	11,481,852,014円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	242,506,712円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,016,797,349円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	696,570,631円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	66,780,734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)	2,795,730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)	8,257,320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)	24,251,129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)	33,378,458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)	20,175,724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)	56,693,417円
外国株式指数ファンド	435,096,975円
三井住友・DCつみたてNISA・全海外株インデックスファンド	1,566,651,714円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	474,783,223円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	523,522,153円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	472,274,091円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,523,232円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	61,679円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	500,231円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,248,132円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	7,586,446円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	10,045,502円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	1,454,059円
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	3,405,545,660円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	13,969,230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〉	1,428,181,270円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	2,279,419,612円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	1,906,787,904円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	8,041,506,595円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	23,772,348円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	131,709,387円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	944,799円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	996,942,559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〉	77,947,358円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	215,733,907円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	938,503,657円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	1,188,241,653円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	2,124,798,531円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	70,103,829円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	946,868,747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)	1,236,144,481円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	182,205,606円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	95,629,329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)	1,441,732,000円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	30,711,234円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	16,976,371円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	8,024,832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 >	61,736,672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 >	141,957,357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 >	141,531,255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 >	1,552,542,864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 >	237,527,799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 >	7,905,074,744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 >	1,255,679,911円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	2,490,575,874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 >	190,295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 >	120,875,054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 >	57,941,009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 >	114,452,268円
合計	58,029,292,656円

(平成30年 5月31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	58,029,292,656円
同期中における追加設定元本額	5,287,442,207円
同期中における一部解約元本額	9,807,791,419円
平成30年 5月31日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	12,705,630,474円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	263,040,867円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,100,886,974円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	762,212,056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)	72,178,110円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2 0 2 0 (4資産タイプ)	2,657,747円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2 0 2 5 (4資産タイプ)	7,967,224円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2 0 3 0 (4資産タイプ)	21,829,082円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2 0 3 5 (4資産タイプ)	38,670,056円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2 0 4 0 (4資産タイプ)	25,321,077円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2 0 4 5 (4資産タイプ)	64,531,371円
外国株式指数ファンド	476,726,548円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 全海外株インデックスファンド	1,977,485,937円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	465,284,623円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	489,452,702円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	425,999,777円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2 0 5 0	3,471,612円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	324,009円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,215,330円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	8,763,005円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	9,807,073円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	36,792,412円
三井住友・DCつみたてN I S A ・ 世界分散ファンド	4,343,213円

S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,678,934,118円
バランスファンドV A (安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	12,016,230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 >	629,122,412円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,973,184,143円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	1,773,091,810円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	7,423,444,492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 >	22,462,366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 >	117,835,696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 >	772,703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 >	921,480,739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 >	67,061,623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 >	198,102,061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 >	886,486,219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 >	861,722,702円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	1,916,249,137円
S M A M ・ バランスV A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	42,707,370円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	873,445,026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)	1,161,452,918円
S M A M ・ グローバルバランス40V A < 適格機関投資家限定 >	168,257,825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 >	86,212,918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)	1,356,564,771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 >	29,139,560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 >	14,944,131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 >	7,525,974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 >	57,276,574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 >	134,110,832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 >	130,300,551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 >	1,427,941,057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 >	210,986,415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 >	7,209,192,241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 >	613,677,704円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンドS A < 適格機関投資家限定 >	1,307,196,158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 >	9,512,767円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-04 < 適格機関投資家限定 >	88,321,911円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2016-05 < 適格機関投資家限定 >	42,301,828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 >	91,302,638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 >	14,545円
合計	53,508,943,444円

4【委託会社等の概況】

(1)【資本金の額】

資本金の額および株式数

	2018年6月29日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

最近5年間における資本金の額の増減
該当ありません。

(2)【事業の内容及び営業の状況】

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

2018年6月29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。

(2018年6月29日現在)

		本数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単体型	88 (41)	345,854 (262,846)
	追加型	466 (198)	5,809,736 (2,828,009)
	計	554 (239)	6,155,590 (3,090,855)
公社債投資信託	単体型	107 (107)	300,164 (300,164)
	追加型	1 (0)	30,353 (0)
	計	108 (107)	330,517 (300,164)
合計		662 (346)	6,486,107 (3,391,019)

()内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

(3)【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項
該当ありません。

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

5【委託会社等の経理状況】

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

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成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 (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)
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葉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葉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	投信の助 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おりません。

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。

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。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年7月10日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小澤 陽一 印指定有限責任社員
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」に掲げられている外国株式指数ファンドの平成29年12月1日から平成30年5月31日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、外国株式指数ファンドの平成30年5月31日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成29年12月1日から平成30年5月31日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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。