

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成31年3月25日

【発行者名】 三井住友アセットマネジメント株式会社
（平成31年4月1日より、三井住友DSアセットマネジメント株式会社（予定））

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 松下 隆史

【本店の所在の場所】 東京都港区愛宕二丁目5番1号

【事務連絡者氏名】 土田 雅央

【電話番号】 03-5405-0740

【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券に係るファンドの名称】 日本消費関連株ファンド（資産成長型）

【届出の対象とした募集内国投資信託
受益証券の金額】 1兆円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2019年3月15日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の記載事項のうち、有価証券報告書の提出等に伴う訂正事項がありますので、本訂正届出書を提出するものではありません。

2【訂正箇所および訂正事項】

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

3 投資リスク

<参考情報>

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

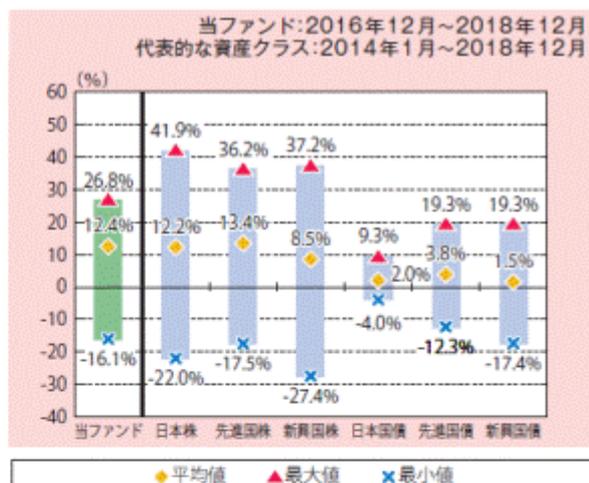
ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



※年間騰落率は、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

※年間騰落率および分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したもとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率および実際の基準価額とは異なる場合があります。

当ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※上記グラフは、上記期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものであり、当ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成しています。全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したもとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

(注)上記グラフにおいて、当ファンドと代表的な資産クラスのデータの期間が異なりますので、ご注意ください。

<各資産クラスの指数について>

資産クラス	指数名	権利者
日本株	TOPIX(配当込み)	株式会社東京証券取引所
先進国株	MSCI コクサイ・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
新興国株	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)	MSCI Inc.
日本国債	NOMURA-BPI 国債	野村證券株式会社
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
新興国債	JP モルガンGBI-EM グローバル・ダイバーシファイド(円ベース)	J.P.Morgan Securities LLC

(注)上記指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利は、各権利者に帰属します。各権利者は、当ファンドの運用に関して一切の責任を負いません。

[次へ](#)

4 手数料等及び税金

下線部は訂正部分を示します。

< 訂正前 >

(5) 課税上の取扱い

(以下略)

* 上記の内容は2018年7月末現在のものですので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

(以下略)

< 訂正後 >

(5) 課税上の取扱い

(以下略)

* 上記の内容は2018年12月末現在のものですので、税法等が変更・改正された場合には、変更になることがあります。

(以下略)

[次へ](#)

5 運用状況

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

日本消費関連株ファンド（資産成長型）

(1) 投資状況

(2018年12月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
親投資信託受益証券 (日本消費関連株マザーファンド)	日本	1,276,013,098	100.21%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,695,677	0.21%
純資産総額		1,273,317,421	100.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(2018年12月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1 日本消費関連株マザーファンド 日本	親投資信託受益 証券 -	1,259,264,876	0.9597 1,208,546,952	1.0133 1,276,013,098	- -	100.21%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
親投資信託受益証券	100.21%
合計	100.21%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

(2018年12月末現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(2018年12月末現在)

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額(百万円)		1口当りの純資産額(円)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
設定時 (2015年12月25日)	3,413	-	1.0000	-
第1計算期間末 (2016年12月26日)	2,986	-	0.9498	-
第2計算期間末 (2017年12月25日)	1,685	-	1.1552	-
2017年12月末日	1,671	-	1.1510	-
2018年1月末日	1,728	-	1.1883	-
2018年2月末日	1,725	-	1.1595	-
2018年3月末日	1,702	-	1.1488	-
2018年4月末日	1,732	-	1.1673	-
2018年5月末日	1,685	-	1.1646	-
2018年6月末日	1,660	-	1.1621	-
2018年7月末日	1,638	-	1.1699	-
2018年8月末日	1,587	-	1.1524	-
2018年9月末日	1,641	-	1.2078	-
2018年10月末日	1,424	-	1.0774	-
2018年11月末日	1,433	-	1.0823	-
第3計算期間末 (2018年12月25日)	1,208	-	0.9148	-
2018年12月末日	1,273	-	0.9658	-

(注) 純資産総額は百万円未満切捨てで表記しております。

分配の推移

該当事項はありません。

収益率の推移

期間	収益率
第1期(2015年12月25日～2016年12月26日)	5.0%
第2期(2016年12月27日～2017年12月25日)	21.6%
第3期(2017年12月26日～2018年12月25日)	20.8%

(注) 収益率 = (当計算期末分配基準価額 - 前計算期末分配基準価額) ÷ 前計算期末分配基準価額 × 100

(4) 設定及び解約の実績

期間	設定総額(円)	解約総額(円)
第1期(2015年12月25日～2016年12月26日)	6,362,331,808	3,217,950,955
第2期(2016年12月27日～2017年12月25日)	272,573,322	1,957,814,329
第3期(2017年12月26日～2018年12月25日)	259,199,316	397,833,211

(注) 本邦外における設定及び解約の実績はありません。

(参考) マザーファンドの運用状況

日本消費関連株マザーファンド

(1) 投資状況

(2018年12月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	時価合計(円)	投資比率
株式	日本	3,059,069,680	88.92%
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		381,095,791	11.08%
純資産総額		3,440,165,471	100.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

その他の資産の投資状況

(2018年12月末現在)

投資資産の種類	国・地域名	買建/ 売建	時価合計(円)	投資比率
株価指数先物	日本	買建	253,895,000	7.38%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

(2018年12月末現在)

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名 国・地域	種類 業種	株数、口数 又は額面金額	簿価単価(円) 簿価(円)	評価単価(円) 時価(円)	利率(%) 償還期限	投資 比率
1	本田技研工業 日本	株式 輸送用機器	52,300	2,756.00 144,138,800	2,894.50 151,382,350	- -	4.40%
2	トヨタ自動車 日本	株式 輸送用機器	22,000	6,110.70 134,435,582	6,406.00 140,932,000	- -	4.10%
3	ユニ・チャーム 日本	株式 化学	35,300	3,322.00 117,266,600	3,559.00 125,632,700	- -	3.65%
4	三井不動産 日本	株式 不動産業	50,100	2,401.50 120,315,150	2,445.00 122,494,500	- -	3.56%
5	花王 日本	株式 化学	14,000	7,774.41 108,841,808	8,154.00 114,156,000	- -	3.32%
6	ソニー 日本	株式 電気機器	20,000	5,000.00 100,000,000	5,326.00 106,520,000	- -	3.10%
7	東京海上ホールディングス 日本	株式 保険業	19,000	5,030.00 95,570,000	5,236.00 99,484,000	- -	2.89%
8	村田製作所 日本	株式 電気機器	6,600	14,435.00 95,271,000	14,955.00 98,703,000	- -	2.87%
9	スズキ 日本	株式 輸送用機器	17,600	5,340.29 93,989,244	5,567.00 97,979,200	- -	2.85%
10	資生堂 日本	株式 化学	14,000	6,274.00 87,836,000	6,892.00 96,488,000	- -	2.80%
11	信越化学工業 日本	株式 化学	11,200	8,056.00 90,227,200	8,536.00 95,603,200	- -	2.78%
12	ヤクルト本社 日本	株式 食料品	12,000	7,480.00 89,760,000	7,720.00 92,640,000	- -	2.69%
13	S Gホールディングス 日本	株式 陸運業	30,000	2,593.00 77,790,000	2,864.00 85,920,000	- -	2.50%
14	I H I 日本	株式 機械	26,400	2,930.00 77,352,000	3,030.00 79,992,000	- -	2.33%
15	キーエンス 日本	株式 電気機器	1,400	51,520.00 72,128,000	55,680.00 77,952,000	- -	2.27%

16	大塚ホールディングス 日本	株式 医薬品	16,700	4,500.01 75,150,194	4,493.00 75,033,100	-	2.18%
17	昭和電工 日本	株式 化学	20,000	3,200.00 64,000,000	3,270.00 65,400,000	-	1.90%
18	太陽誘電 日本	株式 電気機器	38,900	1,594.00 62,006,600	1,636.00 63,640,400	-	1.85%
19	ソフトバンクグループ 日本	株式 情報・通信業	8,500	7,043.00 59,865,500	7,305.00 62,092,500	-	1.80%
20	S U B A R U 日本	株式 輸送用機器	26,000	2,210.50 57,473,000	2,360.00 61,360,000	-	1.78%
21	武田薬品工業 日本	株式 医薬品	16,500	3,707.48 61,173,558	3,705.00 61,132,500	-	1.78%
22	北海道電力 日本	株式 電気・ガス業	80,000	727.00 58,160,000	760.00 60,800,000	-	1.77%
23	T & Dホールディングス 日本	株式 保険業	47,300	1,250.00 59,125,000	1,279.00 60,496,700	-	1.76%
24	三菱商事 日本	株式 卸売業	20,000	2,821.50 56,430,000	3,020.00 60,400,000	-	1.76%
25	国際石油開発帝石 日本	株式 鉱業	60,900	938.20 57,136,380	981.70 59,785,530	-	1.74%
26	小松製作所 日本	株式 機械	22,000	2,255.50 49,621,000	2,365.50 52,041,000	-	1.51%
27	西武ホールディングス 日本	株式 陸運業	26,000	1,831.25 47,612,749	1,914.00 49,764,000	-	1.45%
28	五洋建設 日本	株式 建設業	80,000	552.00 44,160,000	609.00 48,720,000	-	1.42%
29	ヤフー 日本	株式 情報・通信業	163,100	259.00 42,242,900	274.00 44,689,400	-	1.30%
30	任天堂 日本	株式 その他製品	1,500	27,770.00 41,655,000	29,285.00 43,927,500	-	1.28%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

種類別	投資比率
株式	88.92%
合計	88.92%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類の時価の比率です。

ハ. 投資株式の業種別投資比率

業種別	投資比率
(国内)	
化学	16.15%
輸送用機器	14.38%
電気機器	12.84%
医薬品	4.83%
陸運業	4.82%
食料品	4.66%
保険業	4.65%
機械	3.84%
情報・通信業	3.80%
不動産業	3.56%
小売業	3.50%
サービス業	2.07%
精密機器	1.88%
電気・ガス業	1.77%
卸売業	1.76%
鉱業	1.74%
建設業	1.42%
その他製品	1.28%
小計	88.92%
合計	88.92%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

(2018年12月末現在)

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(2018年12月末現在)

種類	地域	資産名	買建 / 売建	数量	簿価(円)	時価(円)	投資比率
----	----	-----	---------	----	-------	-------	------

株価指数先物	日本	TOPIX 3103月	先物	買建	17	237,490,000	253,895,000	7.38%
--------	----	----------------	----	----	----	-------------	-------------	-------

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

（参考情報）

2018年12月28日現在

基準価額・純資産の推移（設定日～2018年12月28日）



*分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したもとして計算しております。

分配の推移

2018年12月	0円
2017年12月	0円
2016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

主要な資産の状況

投資銘柄	投資比率
日本消費関連株マザーファンド	100.2%

■参考情報

日本消費関連株マザーファンド

上位10銘柄

	投資銘柄	業種	投資比率
1	本田技研工業	輸送用機器	4.4%
2	トヨタ自動車	輸送用機器	4.1%
3	ユニ・チャーム	化学	3.7%
4	三井不動産	不動産業	3.6%
5	花王	化学	3.3%
6	ソニー	電気機器	3.1%
7	東京海上ホールディングス	保険業	2.9%
8	村田製作所	電気機器	2.9%
9	スズキ	輸送用機器	2.8%
10	資生堂	化学	2.8%

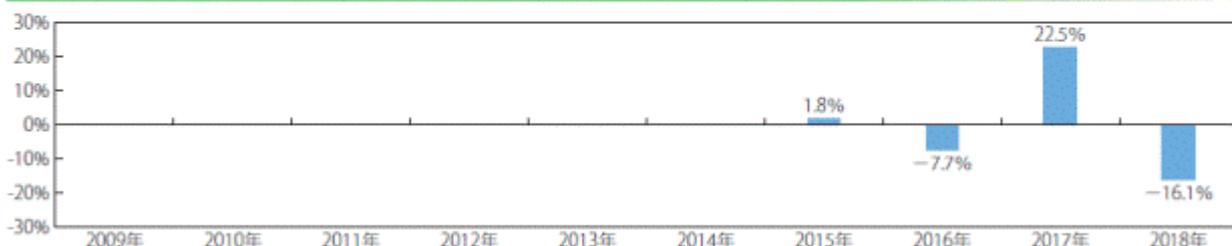
*投資比率は全て純資産総額対比

*業種は東証33業種分類

上位10業種

	業種	投資比率
1	化学	16.1%
2	輸送用機器	14.4%
3	電気機器	12.8%
4	医薬品	4.8%
5	陸運業	4.8%
6	食料品	4.7%
7	保険業	4.7%
8	機械	3.8%
9	情報・通信業	3.8%
10	不動産業	3.6%

年間収益率の推移



*ファンドの収益率は暦年ベースで表示しております。但し、2015年は当初設定日(2015年12月25日)から年末までの収益率です。

*ファンドの年間収益率は、税引前の分配金を再投資したもとして計算しております。

*ファンドには、ベンチマークはありません。

- ・ファンドの運用実績はあくまでも過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ファンドの運用状況は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

[前へ](#)

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

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）並びに同規則第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、財務諸表に記載されている金額は、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3期計算期間（平成29年12月26日から平成30年12月25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る監査を受けております。

[次へ](#)

1 財務諸表

日本消費関連株ファンド（資産成長型）

(1) 貸借対照表

区分	第2期 平成29年12月25日現在 金額（円）	第3期 平成30年12月25日現在 金額（円）
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	1,700,292,655	1,220,079,071
未収入金	3,345,669	3,231,422
流動資産合計	1,703,638,324	1,223,310,493
資産合計	1,703,638,324	1,223,310,493
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,345,669	3,231,422
未払受託者報酬	401,556	330,017
未払委託者報酬	14,056,056	11,551,842
その他未払費用	216,279	156,893
流動負債合計	18,019,560	15,270,174
負債合計	18,019,560	15,270,174
純資産の部		
元本等		
元本	1,459,139,846	1,320,505,951
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	226,478,918	112,465,632
（分配準備積立金）	279,993,864	211,489,184
元本等合計	1,685,618,764	1,208,040,319
純資産合計	1,685,618,764	1,208,040,319
負債純資産合計	1,703,638,324	1,223,310,493

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	第2期 自 平成28年12月27日 至 平成29年12月25日 金額（円）	第3期 自 平成29年12月26日 至 平成30年12月25日 金額（円）
営業収益		
有価証券売買等損益	428,529,334	286,860,892
営業収益合計	428,529,334	286,860,892
営業費用		
受託者報酬	961,907	698,055
委託者報酬	33,669,638	24,434,989
その他費用	216,279	156,893
営業費用合計	34,847,824	25,289,937
営業利益又は営業損失（ ）	393,681,510	312,150,829
経常利益又は経常損失（ ）	393,681,510	312,150,829

当期純利益又は当期純損失()	393,681,510	312,150,829
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()	108,343,174	5,594,124
期首剰余金又は期首欠損金()	157,761,236	226,478,918
剰余金増加額又は欠損金減少額	98,901,818	41,185,356
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	95,724,855	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	3,176,963	41,185,356
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	62,384,953
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	62,384,953
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	226,478,918	112,465,632

[次へ](#)

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第3期	
	自 平成29年12月26日	至 平成30年12月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、基準価額で評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、前計算期末及び当計算期末が休日のため、平成29年12月26日から平成30年12月25日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第2期		第3期	
	平成29年12月25日現在		平成30年12月25日現在	
1. 元本状況				
期首元本額	3,144,380,853円		1,459,139,846円	
期中追加設定元本額	272,573,322円		259,199,316円	
期中一部解約元本額	1,957,814,329円		397,833,211円	
2. 受益権の総数	1,459,139,846口		1,320,505,951口	
3. 元本の欠損	-		112,465,632円	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期		第3期	
自 平成28年12月27日		自 平成29年12月26日	
至 平成29年12月25日		至 平成30年12月25日	
分配金の計算過程 該当事項はありません。		分配金の計算過程 該当事項はありません。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	第3期	
	自 平成29年12月26日	至 平成30年12月25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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であります。なお、当ファンドは親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資し、また、デリバティブ取引を行っております。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、リスク管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。	
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、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された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拠った場合、当該価額が異なることもあります。	

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期	
	平成30年12月25日現在	

1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、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 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第2期(平成29年12月25日現在)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	306,227,695
合計	306,227,695

第3期(平成30年12月25日現在)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	294,723,582
合計	294,723,582

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第2期(平成29年12月25日現在)

該当事項はありません。

第3期(平成30年12月25日現在)

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3期(自平成29年12月26日 至 平成30年12月25日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第2期 平成29年12月25日現在	第3期 平成30年12月25日現在
1口当たり純資産額 1.1552円 「1口 = 1円(10,000口 = 11,552円)」	1口当たり純資産額 0.9148円 「1口 = 1円(10,000口 = 9,148円)」

(4) 附属明細表

有価証券明細表

<株式以外の有価証券>

通貨	種類	銘柄	口数	評価額	備考
円	親投資信託 受益証券	日本消費関連株マザーファンド	1,271,312,985	1,220,079,071	
	合計	1銘柄	1,271,312,985	1,220,079,071	

[前へ](#) [次へ](#)

<参考>

当ファンドは、「日本消費関連株マザーファンド」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あります。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

日本消費関連株マザーファンド

(1) 貸借対照表

区分	第2期 平成29年12月25日現在 金額(円)	第3期 平成30年12月25日現在 金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	-	245,877,695
コール・ローン	606,713,523	66,085,702
株式	4,496,561,300	2,909,850,130
派生商品評価勘定	5,164,914	-
未収入金	68,543,900	93,123,704
未収配当金	-	90,000
前払金	-	14,460,000
差入委託証拠金	13,050,000	8,670,000
流動資産合計	5,190,033,637	3,338,157,231
資産合計	5,190,033,637	3,338,157,231
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	27,974,113
前受金	9,655,000	-
未払金	34,028,209	23,119,449
未払解約金	23,125,921	5,755,251
その他未払費用	-	8,403
流動負債合計	66,809,130	56,857,216
負債合計	66,809,130	56,857,216
純資産の部		
元本等		
元本	4,304,182,353	3,418,919,224
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	819,042,154	137,619,209
元本等合計	5,123,224,507	3,281,300,015
純資産合計	5,123,224,507	3,281,300,015
負債純資産合計	5,190,033,637	3,338,157,231

[前へ](#) [次へ](#)

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第3期	
	自 平成29年12月26日	至 平成30年12月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等の提示する気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>また、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき原則として時価で評価しております。	
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1) 受取配当金 国内株式についての受取配当金は、原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>(2) 有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	当ファンドの計算期間は、前計算期末及び当計算期末が休日のため、平成29年12月26日から平成30年12月25日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第2期		第3期	
	平成29年12月25日現在		平成30年12月25日現在	
1. 元本状況				
期首元本額	9,020,669,367円		4,304,182,353円	
期中追加設定元本額	417,840,022円		475,040,988円	
期中一部解約元本額	5,134,327,036円		1,360,304,117円	
元本の内訳				
日本消費関連株ファンド（予想分配金提示型）	2,875,725,111円		2,147,606,239円	
日本消費関連株ファンド（資産成長型）	1,428,457,242円		1,271,312,985円	
合計	4,304,182,353円		3,418,919,224円	
2. 受益権の総数	4,304,182,353口		3,418,919,224口	
3. 元本の欠損			137,619,209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	第3期	
	自 平成29年12月26日	至 平成30年12月25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、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有している金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であります。これらの金融商品に係るリスクは、価格変動リスク、信用リスク及び流動性リスクであります。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のファンドの運用におけるリスク管理については、運用部門から独立した組織体制で行っております。運用管理委員会（代表取締役社長を委員長とします。）は、ファンドの運用状況を総合的に分析・評価するとともに、運用リスク管理の強化・改善に向けた方策を討議・決定しております。また、リスク管理部運用審査室は、ファンドのパフォーマンス分析・評価並びにリスク分析を行い、運用部門に開示するとともに、運用管理委員会を通じて、運用リスクの軽減に向けた提言を行っております。	

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、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された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拠った場合、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係る市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	---

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 平成30年12月25日現在	
	種類	金額(円)
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額		金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法		(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引等関係に関する注記に記載しております。 (3)金銭債権及び金銭債務 短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第2期(平成29年12月25日現在)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株 式	728,260,404
合計	728,260,404

第3期(平成30年12月25日現在)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
株 式	594,997,826
合計	594,997,826

(デリバティブ取引等関係に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(株式関連)

区分	種類	第2期 平成29年12月25日現在			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建 T O P I X	214,495,086	-	219,660,000	5,164,914
	合計	-	-	219,660,000	5,164,914

区分	種類	第3期 平成30年12月25日現在			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 買建 T O P I X	265,464,113	-	237,490,000	27,974,113
	合計	-	-	237,490,000	27,974,113

(注)時価の算定方法

- 1) 先物取引の残高表示は、契約額によっております。
- 2) 期末の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段等を用いております。

(関連当事者との取引に関する注記)

第3期(自平成29年12月26日 至 平成30年12月25日)

該当事項はありません。

(1口当たり情報)

第2期 平成29年12月25日現在	第3期 平成30年12月25日現在
1口当たり純資産額 1.1903円 「1口 = 1円(10,000口 = 11,903円)」	1口当たり純資産額 0.9597円 「1口 = 1円(10,000口 = 9,597円)」

(3) 附属明細表

有価証券明細表

<株式>

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
円	国際石油開発帝石	60,900	938.20	57,136,380	
	五洋建設	80,000	552.00	44,160,000	
	ヤクルト本社	18,000	7,480.00	134,640,000	
	雪印メグミルク	5,000	2,658.00	13,290,000	
	日本たばこ産業	15,000	2,587.00	38,805,000	
	昭和電工	20,000	3,200.00	64,000,000	
	信越化学工業	11,200	8,056.00	90,227,200	
	積水化学工業	20,000	1,545.00	30,900,000	
	花王	10,400	7,702.00	80,100,800	
	富士フイルムホールディングス	6,000	4,051.00	24,306,000	
	資生堂	19,000	6,274.00	119,206,000	
	ユニ・チャーム	35,300	3,322.00	117,266,600	
	協和発酵キリン	30,100	1,986.00	59,778,600	
	武田薬品工業	7,000	3,640.00	25,480,000	
	日本新薬	4,300	6,510.00	27,993,000	
	大塚ホールディングス	11,000	4,473.00	49,203,000	
	小松製作所	29,600	2,255.50	66,762,800	
	I H I	26,400	2,930.00	77,352,000	
	ルネサスエレクトロニクス	40,000	440.00	17,600,000	
	ソニー	20,000	5,000.00	100,000,000	
	T D K	4,600	7,190.00	33,074,000	
	キーエンス	1,400	51,520.00	72,128,000	
	レーザーテック	14,000	2,545.00	35,630,000	
	太陽誘電	38,900	1,594.00	62,006,600	
	村田製作所	6,600	14,435.00	95,271,000	
	トヨタ自動車	20,000	6,079.00	121,580,000	
	日野自動車	12,000	994.00	11,928,000	
	本田技研工業	52,300	2,756.00	144,138,800	
	スズキ	13,600	5,272.00	71,699,200	
	S U B A R U	26,000	2,210.50	57,473,000	
	豊田合成	14,000	2,028.00	28,392,000	
	パイ・テクノロジー	2,000	11,720.00	23,440,000	
	H O Y A	6,000	6,093.00	36,558,000	
	任天堂	1,500	27,770.00	41,655,000	
	北海道電力	80,000	727.00	58,160,000	
	西武ホールディングス	20,000	1,806.00	36,120,000	
	ヤマトホールディングス	10,000	2,779.00	27,790,000	
	S Gホールディングス	30,000	2,593.00	77,790,000	
	ヤフー	163,100	259.00	42,242,900	
	ネットワンシステムズ	12,400	1,774.00	21,997,600	
	ソフトバンクグループ	8,500	7,043.00	59,865,500	
三菱商事	20,000	2,821.50	56,430,000		
ビックカメラ	24,600	1,325.00	32,595,000		
コスモス薬品	2,000	17,720.00	35,440,000		
ワークマン	3,000	6,970.00	20,910,000		
新生銀行	20,000	1,265.00	25,300,000		
東京海上ホールディングス	19,000	5,030.00	95,570,000		
T & Dホールディングス	47,300	1,250.00	59,125,000		
三井不動産	50,100	2,401.50	120,315,150		
電通	8,000	4,565.00	36,520,000		
リクルートホールディングス	12,000	2,541.50	30,498,000		
合計	51銘柄	1,212,100	-	2,909,850,130	

デリバティブ取引の契約額等及び時価の状況表

注記表中の(デリバティブ取引等関係に関する注記)に記載しており、ここでは省略しております。

[前へ](#) [次へ](#)

2 ファンドの現況
純資産額計算書
(2018年12月末現在)

日本消費関連株ファンド(資産成長型)

資産総額	1,276,013,098	円
負債総額	2,695,677	円
純資産総額(-)	1,273,317,421	円
発行済数量	1,318,418,221	口
1単位当り純資産額(/)	0.9658	円

(参考)日本消費関連株マザーファンド

資産総額	3,629,894,704	円
負債総額	189,729,233	円
純資産総額(-)	3,440,165,471	円
発行済数量	3,395,048,282	口
1単位当り純資産額(/)	1.0133	円

[前へ](#)

第三部【委託会社等の情報】

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

原届出書の内容は下記事項の内容に訂正されます。

(1) 受託会社

名称	資本金の額（百万円） 2018年9月末現在	事業の内容
株式会社S M B C 信託銀行	87,550	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（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

<参考：再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）の概要>

- ・資本金：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。
- ・再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社（日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）へ委託するため、原信託財産の全てを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

(2) 販売会社

名称	資本金の額（百万円） 2018年9月末現在	事業の内容
株式会社三井住友銀行	1,770,996	銀行法に基づき、監督官庁の免許を受け銀行業を営んでいます。
株式会社福岡銀行	82,329	
株式会社親和銀行	36,878	
株式会社熊本銀行	33,847	
S M B C 日興証券株式会社	10,000	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。

以上

独立監査人の監査報告書

平成31年1月25日

大和住銀投信投資顧問株式会社
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 飯田 浩司 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 佐藤 栄裕 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」に掲げられている日本消費関連株ファンド（資産成長型）の平成29年12月26日から平成30年12月25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、日本消費関連株ファンド（資産成長型）の平成30年12月25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

大和住銀投信投資顧問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。

(注2) XBRLデータは監査の対象には含まれていません。