

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2019年10月28日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社 (2020年4月1日より、大和アセットマネジメント株式会社(予定))
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏 場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【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】	財形株投(年金・住宅財形30)
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部 【証券情報】

(1) 【ファンドの名称】

財形株投（年金・住宅財形30）

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

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

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(3) 【発行(売出)価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の基準価額とします。

（注）当ファンドにおいては、取得申込代金（取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。）は原則として給与天引きとし、取得申込受付日は「勤労者財産形成年金貯蓄契約」または「勤労者財産形成住宅貯蓄契約」に定める日とします。

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）
電話番号（コールセンター） 0120-106212
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(5) 【申込手数料】

取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

(6) 【申込単位】

1,000円単位

(7) 【申込期間】

2019年10月29日から2020年4月24日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

委託会社にお問合わせ下さい。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、「勤労者財産形成年金貯蓄契約」または「勤労者財産形成住宅貯蓄契約」に定める日に、原則として給与天引きで販売会社に支払うものとします。

販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、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込みます。

(10) 【払込取扱場所】

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、原則として給与天引きで申込取扱場所において支払うものとします。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

当ファンドは、財形貯蓄制度を利用する勤労者のみなさま専用のファンドであり、積立てた資金を原資としての年金の受取りや、住宅の購入・増改築資金作りのための非課税優遇貯蓄です。55歳未満の勤労者の方であればどなたでも加入することができます。

受益権の取得申込者は、事業主を通じて、販売会社に取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドは、積立投資専用です。

イ．取得申込者は、販売会社と別に定める「勤労者財産形成年金貯蓄約款」または「勤労者財産形成住宅貯蓄約款」にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を結ぶものとします。

ロ．積立ては、原則として5年以上とさせていただきます。

ハ．毎年1回（原則として2月1日決算）の収益分配金は、自動的に再投資されます。なお、積立てられた元金および収益分配金の累計額が限度額（年金財形・住宅財形の合計で550万円）以下であるときは、収益分配金に税金はかかりません。なお、2月1日または2月2日のいずれかが委託会社の休業日にあたる場合には、2月1日以降の営業日で、翌日が営業日である日のうち、1日に最も近い日を決算日とします。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

取得申込金額に利息は付きません。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、信託財産の成長と安定した収益の確保を目的として、安定運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	国内
	投資対象資産(収益の源泉)	資産複合
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券）））
	決算頻度	年1回
	投資対象地域	日本
	投資形態	ファミリーファンド

(注1) 商品分類の定義

- ・「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なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「国内」...目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）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
- ・「資産複合」...目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

(注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」...組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分固定型」...目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- ・「年1回」...目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「日本」...目論見書等において、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
- ・「ファミリーファンド」...目論見書等において、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きます。）を投資対象として投資するもの

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国内	株式
追加型投信	海外	債券
	内外	不動産投信
		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
株式	年1回	グローバル	ファミリー ファンド
一般 大型株 中小型株	年2回	日本	
債券	年4回	北米	ファンド・オブ・ ファンズ
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州	
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア	
その他資産 (投資信託証券) (資産複合 資産配分) (固定型(株式、債券))	日々	オセアニア	
資産複合 ()	その他 ()	中南米	
資産配分固定型 資産配分変更型		アフリカ	
		中近東 (中東)	
		エマージング	

(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・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス <http://www.toushin.or.jp/>）をご参照下さい。

< 信託金の限度額 >

- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、2,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

1 内外の公社債への投資により安定収益の確保をはかるとともに、わが国の株式部分については東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果をめざして、全体として安定運用を行ないます。

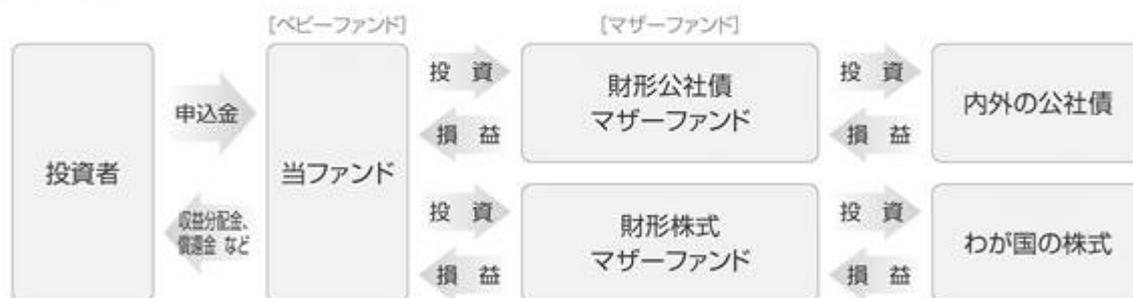
※東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所の第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、市場全体の株価の変動をとらえようとするものです。

- わが国の株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の30%としたうえ、常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

ファンドの仕組み

- 当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。なお、ベビーファンドから内外の公社債およびわが国の株式への直接投資を行なうことができますものとしてします。



2 当ファンドは、財形貯蓄制度を利用する勤労者のみなさま専用のファンドです。勤労者財産形成年金貯蓄（年金財形）または勤労者財産形成住宅貯蓄（住宅財形）を利用する場合に投資できます。

- 積立てた資金を原資としての年金の受取りや、住宅の購入・増改築資金作りのための非課税優遇貯蓄です。55歳未満の勤労者の方であれば購入することができます。
- 積立投資専用のファンドです。積立ては、原則として5年以上とします。

3 原則として、毎年2月1日に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。収益分配金は、自動的に再投資されます。なお、2月1日または2月2日のいずれかが委託会社の休業日にあたる場合には、2月1日以降の営業日で、翌日が営業日である日のうち、1日に最も近い日を決算日とします。

〈分配方針〉

- ①分配対象額は、利息等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
 - ②分配対象額から、原則として、利息等収益を中心に安定的に分配します。
- ※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。

(2) 【ファンドの沿革】

1994年2月4日

信託契約締結、当初設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者	お申込者	
	収益分配金（注）、償還金など お申込金（ 3）	
お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行いません。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2）の委託者であり、次の業務を行いません。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2 損益 信託金（ 3）	
受託会社	<p>みずほ信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社</p>	<p>信託契約（ 2）の受託者であり、次の業務を行いません。なお、信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行な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なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
	損益 投資	
投資対象	<p>内外の公社債、わが国の株式 など （ファミリーファンド方式で運用を行いません。）</p>	

（注）収益分配金は自動的に再投資されます。

- 1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
- 3：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、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込みます。

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

< 委託会社の概況（2019年8月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

1959年12月12日	設立登記
1960年 2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
1960年 4月 1日	営業開始
1985年11月 8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
1995年 5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
1995年 9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
2007年 9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。 (金融商品取引業者登録番号：関東財務局長（金商）第352号)

・ 大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

財形公社債マザーファンド受益証券および財形株式マザーファンド受益証券ならびに内外の公社債およびわが国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

主として財形公社債マザーファンド受益証券および内外の公社債への投資により安定した収益の確保をはかり、主として財形株式マザーファンド受益証券およびわが国の株式への投資により信託財産の成長をめざします。

財形株式マザーファンド受益証券および株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の30%としたうえ、常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。

(2) 【投資対象】

委託会社は、信託金を、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、みずほ信託銀行株式会社を受託者として締結された財形公社債マザーファンドの受益証券および財形株式マザーファンドの受益証券ならびに次の有価証券(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ます。)で市場性のあるもの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券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券(以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。))の新株引受権証券を除きます。)
6. コマーシャル・ペーパー
7. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前6.までの証券または証書の性質を有するもの
8. 新株引受権証券(分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。))および新株予約権証券(外国または外国の者の発行する証券または証書で、かかる性質を有するものを含みます。以下同じ。))
9. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
10. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
11. 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。)
12. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの
13. 外国の者に対する権利で前12.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書および前7.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前5.までの証券および前7.の証券のうち前2.から前5.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

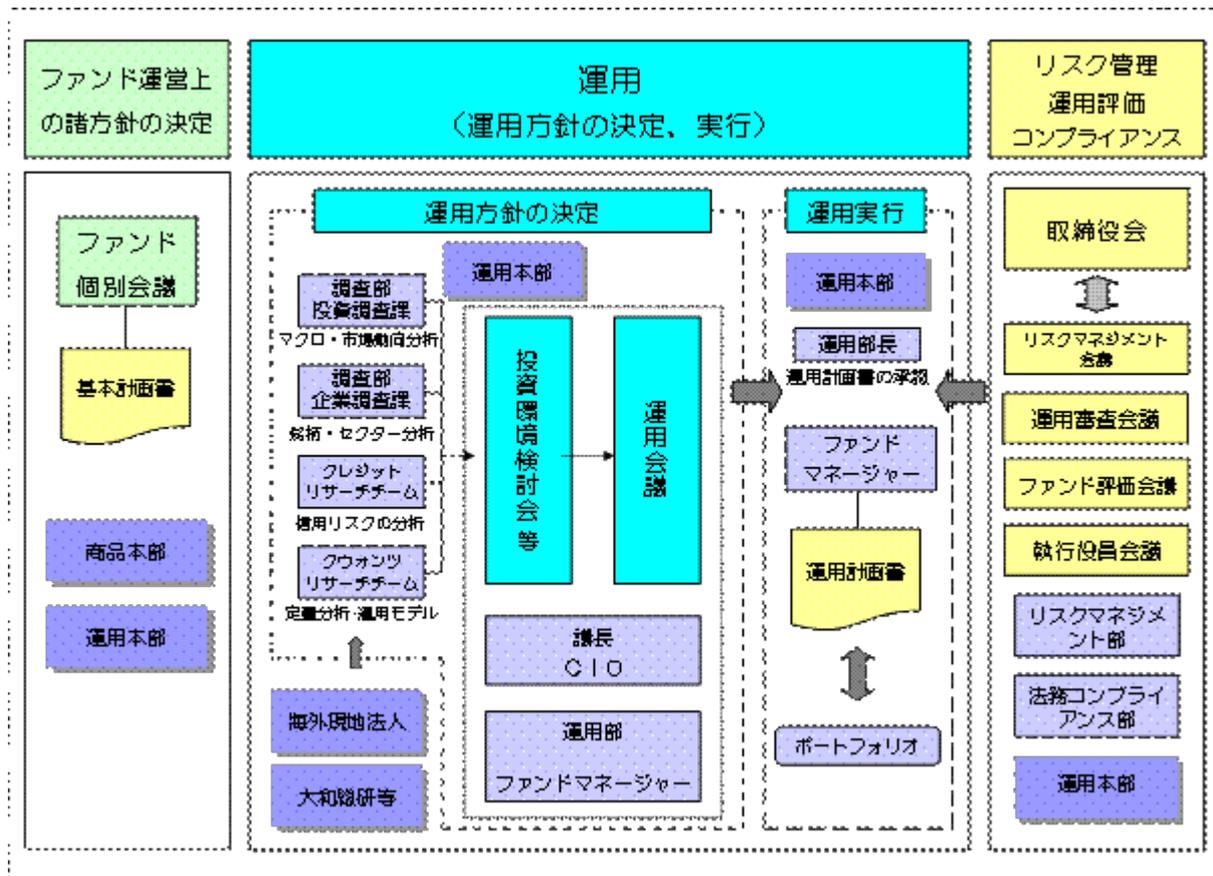
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。))により運用することを指図することができます。

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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ．投資環境の検討

運用最高責任者であるCIO（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ．基本的な運用方針の決定

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ．運用計画書の作成・承認

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営

- ・ファンドマネージャーの任命・変更
- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的確な状況報告
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は30～40名程度です。

イ．ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

ロ．運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ハ．リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

ニ．執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

上記の運用体制は2019年8月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

分配対象額は、利息等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

分配対象額から、原則として、利息等収益を中心に安定的に分配します。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する株式、新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額と、財形株式マザーファンドの信託財産に属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する財形株式マザーファンドの受益証券の時価総額に、財形株式マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

新株引受権証券等（信託約款）

委託会社は、取得時において信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

投資する株式等の範囲（信託約款）

委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場（上場予定を含みます。）されている株式の発行会社の発行するもの、金融商品取引所に準ずる市場において取引（登録予定を含みます。）されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

同一銘柄の株式等（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額と財形株式マザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する財形株式マザーファンドの受益証券の時価総額に、財形株式マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ハ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

信用取引（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。

ロ．前イ．の信用取引の指図は、次の1.から6.までに掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の1.から6.までに掲げる株券数の合計数を超えないものとし、

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の

旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券

6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前5.に定めるものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等(信託約款)

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品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。)、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。)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。)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次の範囲で行な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て取扱うものとします(以下同じ。)

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額(組入有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

ロ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、ヘッジの対象とする外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

ハ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における金利にかかる先物取引および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次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする金利商品(以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。)の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点のヘッジ対象金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引(信託約款)

- イ. 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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額と財形公社債マザーファンドおよび財形株式マザーファンド(以下本八.において「マザーファンド」といいます。)の信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下本八.において「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. 前八.においてマザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- ホ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

デリバティブ取引等(信託約款)

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。

同一銘柄の転換社債等(信託約款)

- イ. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額と、財形公社債マザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および転換社債型新株予約権付

社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する財形公社債マザーファンドの受益証券の時価総額に、財形公社債マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

有価証券の貸付け（信託約款）

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範囲内で貸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の50%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．前イ．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、すみ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なうものとします。

外貨建資産（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額と、財形公社債マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上り等により100分の30を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

ロ．前イ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属する財形公社債マザーファンドの受益証券の時価総額に、財形公社債マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約の指図（信託約款）

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

信用リスク集中回避（信託約款）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一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100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

資金の借入れ（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに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な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解約代金入金日までの間もしくは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。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

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。

ニ. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

<参考> マザーファンドの概要

1. 財形公社債マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

主として内外の公社債への投資により、安定した収益の確保をはかります。

(2) 投資対象

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券(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ます。)に投資することを指図します。

1. 国債証券
 2. 地方債証券
 3. 特別の法律により法人の発行する債券
 4. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)に限りませう。)
 5. コマーシャル・ペーパー
 6. 外国または外国の者の発行する証券で、前1.から前5.までの証券の性質を有するもの
 7. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 8. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 9. 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せう。)
 10. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 11. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの
 12. 外国の者に対する権利で前11.の有価証券の性質を有するもの
- なお、前1.から前4.までの証券および前6.の証券のうち前1.から前4.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といいます。

委託会社は、信託金を、前 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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

(3) 主な投資制限

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

有価証券等の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等を行なうことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、スワップ取引を行なうことができます。

2. 財形株式マザーファンド

(1) 投資方針

主要投資対象

東京証券取引所第一部上場株式を主要投資対象とします。

投資態度

東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果をめざします。

(2) 投資対象

委託会社は、信託金を、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ます。)で市場性のあるもの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. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
3. 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。)
4. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第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表示されるべきもの

なお、前1.の証券または証書を以下「株式」といいます。

委託会社は、信託金を、前 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

5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

信託財産の効率的な運用に資するため、および有価証券等の価格変動リスクを回避するため、有価証券先物取引等を行なうことができます。

信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、スワップ取引を行なうことができます。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

当ファンドは、株式、公社債など値動きのある証券に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

投資者のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

その他

イ．解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります（信用リスク）。この場合、基準価額が下落する要因となります。

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

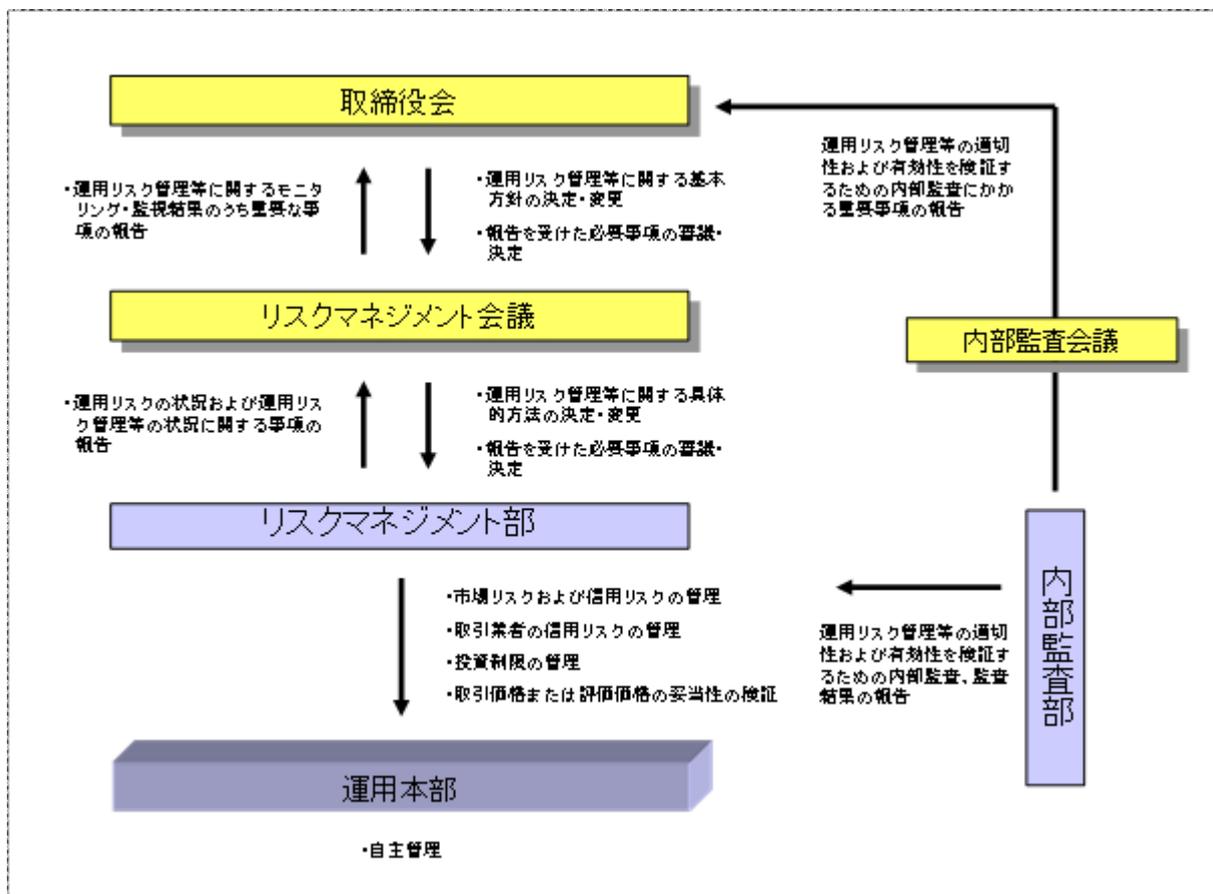
金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



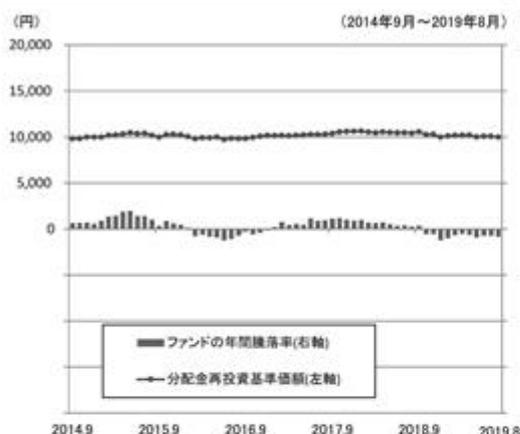
流動性リスクに対する管理体制

当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

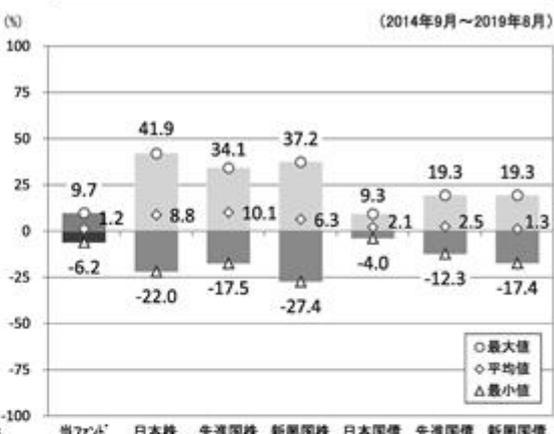
参 考 情 報

- 下記のグラフは、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たものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、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。

※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。

- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
- ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
- ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）
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）
日本国債：NOMURA-BPI国債
先進国債：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー 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）

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー 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は、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性、正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

取得申込時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。なお、申込手数料を徴収している販売会社はありません。

取得申込時の申込手数料については、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.617%（税抜1.47%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.3311% （税抜）	年率1.0639% （税抜）	年率0.075% （税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

前 の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価

販売会社：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：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

（ ）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

< マザーファンドより支弁する手数料等 >

各マザーファンドの投資対象等に応じて、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者が支払いを受ける収益分配金ならびに一部解約金および償還時の個別元本の金額を超える部分の金額には非課税の特典により税金はかかりません。ただし、積立てられた元金および収益分配金の累計額が限度額（年金財形・住宅財形の合計で550万円）を超える場合には、非課税の特典を失い、下記の取扱いとなります。

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の金額を超える部分の金額については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

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、上場株式等（特定公社債、公募公社債投資信託を含みます。）の譲渡益および償還差益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得および利子所得との損益通算も可能となります。また、翌年以後3年間、上場株式等の譲渡益・償還差益および配当等・利子から繰越控除することができます。一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損および償還差損との相殺が可能となります。

なお、年金の受取り・住宅の取得等以外の目的で一部解約の実行を請求する場合には、原則として非課税の特典を失い、その事実の生じた日前5年以内に支払われた収益分配金については、その事実が生じた日において、その収益分配金の支払いがあったものとみなして、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の追徴課税が行なわれますことをご留意下さい。

< 注1 > 個別元本について

投資者ごと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に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。なお、個別元本方式は2000年4月1日算出の基準価額より適用されておりますので、個別元本方式への移行時に既に受益権を保有していた場合、2000年3月31日の平均信託金が当該受益権にかかる個別元本となります。

投資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、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資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、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

投資者が元本払戻金(特別分配金)を受取った場合、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、その後の当該投資者の個別元本となります。

<注2> 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)」(投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資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、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資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。

- () 2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- () 上記は、2019年8月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- () 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（2019年8月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	555,823,297	96.12
内 日本	555,823,297	96.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	22,411,067	3.88
純資産総額	578,234,364	100.00

(注1) 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。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】（2019年8月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 財形公社債マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	293,239,660	1.3343 391,269,686	1.3391 392,677,228	67.91
2 財形株式マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	113,873,155	1.4793 168,455,873	1.4327 163,146,069	28.21

(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

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	96.12%
合計	96.12%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

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】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第16計算期間末 (2010年2月1日)	478,042,282	478,042,282	0.8752	0.8752
第17計算期間末 (2011年2月1日)	501,578,632	501,578,632	0.8733	0.8733
第18計算期間末 (2012年2月1日)	481,912,061	481,912,061	0.8266	0.8266
第19計算期間末 (2013年2月4日)	500,411,406	500,411,406	0.8807	0.8807
第20計算期間末 (2014年2月3日)	523,085,376	523,085,376	0.9440	0.9440
第21計算期間末 (2015年2月2日)	559,747,869	559,747,869	0.9907	0.9907
第22計算期間末 (2016年2月1日)	580,807,429	580,807,429	1.0048	1.0048
第23計算期間末 (2017年2月1日)	582,764,134	582,764,134	1.0088	1.0088
第24計算期間末 (2018年2月1日)	618,874,817	618,874,817	1.0619	1.0619
2018年8月末日	602,043,864	-	1.0343	-
9月末日	613,591,145	-	1.0492	-
10月末日	595,169,093	-	1.0191	-
11月末日	600,158,002	-	1.0223	-
12月末日	590,793,516	-	0.9922	-
2019年1月末日	596,432,137	-	1.0051	-
第25計算期間末 (2019年2月4日)	597,947,800	597,947,800	1.0076	1.0076
2月末日	588,283,368	-	1.0110	-
3月末日	589,447,557	-	1.0111	-
4月末日	589,312,231	-	1.0139	-
5月末日	571,580,770	-	0.9932	-

6月末日	582,509,664	-	1.0003	-
7月末日	581,815,672	-	1.0014	-
8月末日	578,234,364	-	0.9920	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第16計算期間	0.0000
第17計算期間	0.0000
第18計算期間	0.0000
第19計算期間	0.0000
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000
第24計算期間	0.0000
第25計算期間	0.0000
2019年2月5日～ 2019年8月4日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第16計算期間	4.4
第17計算期間	0.2
第18計算期間	5.3
第19計算期間	6.5
第20計算期間	7.2
第21計算期間	4.9
第22計算期間	1.4
第23計算期間	0.4
第24計算期間	5.3
第25計算期間	5.1
2019年2月5日～ 2019年8月4日	1.2

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第16計算期間	75,552,755	37,527,979
第17計算期間	72,015,919	43,878,831
第18計算期間	67,989,496	59,301,069

第19計算期間	54,885,565	69,700,740
第20計算期間	51,698,606	65,801,384
第21計算期間	51,642,707	40,751,490
第22計算期間	48,974,802	35,916,614
第23計算期間	55,808,965	56,162,026
第24計算期間	50,328,668	45,253,987
第25計算期間	51,449,630	40,795,634
2019年2月5日～ 2019年8月4日	25,258,496	37,699,986

(参考) マザーファンド

財形公社債マザーファンド

(1) 投資状況 (2019年8月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	607,335,175	50.59
内 日本	607,335,175	50.59
地方債証券	537,469,941	44.77
内 日本	537,469,941	44.77
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	55,795,032	4.65
純資産総額	1,200,600,148	100.00

(注1) 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。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産 (2019年8月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	17 物価連動国債	日本	国債証券	50,000,000	107.52 53,761,250	106.73 53,367,875	0.100000 2023/09/10	4.45
2	736 東京都公債	日本	地方債証券	50,000,000	102.70 51,350,900	102.83 51,417,450	0.505000 2024/09/20	4.28
3	345 10年国債	日本	国債証券	40,000,000	101.86 40,747,600	103.64 41,456,800	0.100000 2026/12/20	3.45

4	325 10年国債	日本	国債証券	35,000,000	103.53 36,237,250	103.46 36,212,400	0.800000 2022/09/20	3.02
5	310 10年国債	日本	国債証券	35,000,000	101.91 35,671,650	101.33 35,465,850	1.000000 2020/09/20	2.95
6	24 - 4 福岡市公債	日本	地方債証券	32,000,000	102.96 32,949,280	102.61 32,838,336	0.800000 2022/10/31	2.74
7	339 10年国債	日本	国債証券	30,000,000	103.60 31,080,900	104.56 31,368,300	0.400000 2025/06/20	2.61
8	343 10年国債	日本	国債証券	30,000,000	101.90 30,570,300	103.31 30,993,900	0.100000 2026/06/20	2.58
9	386 大阪府公債	日本	地方債証券	30,000,000	102.94 30,882,540	103.10 30,930,540	0.585000 2024/07/30	2.58
10	318 10年国債	日本	国債証券	30,000,000	103.08 30,924,300	102.68 30,804,000	1.000000 2021/09/20	2.57
11	303 10年国債	日本	国債証券	30,000,000	100.99 30,297,000	100.07 30,022,200	1.400000 2019/09/20	2.50
12	25 - 1 滋賀県公債	日本	地方債証券	28,000,000	102.66 28,747,320	102.94 28,824,796	0.650000 2023/11/29	2.40
13	27 - 2 熊本県公債	日本	地方債証券	27,690,000	102.90 28,495,086	103.20 28,576,855	0.476000 2025/10/30	2.38
14	332 10年国債	日本	国債証券	27,000,000	103.75 28,014,120	104.12 28,113,210	0.600000 2023/12/20	2.34
15	24 - 13 愛知県公債	日本	地方債証券	27,000,000	102.92 27,789,696	102.60 27,703,161	0.772000 2022/11/30	2.31
16	24 - 10 札幌市公債	日本	地方債証券	25,000,000	103.07 25,768,800	102.74 25,685,150	0.800000 2022/12/20	2.14
17	315 10年国債	日本	国債証券	25,000,000	103.27 25,818,000	102.69 25,672,750	1.200000 2021/06/20	2.14
18	312 10年国債	日本	国債証券	25,000,000	102.58 25,645,250	101.92 25,480,500	1.200000 2020/12/20	2.12
19	305 10年国債	日本	国債証券	25,000,000	101.30 25,325,000	100.44 25,110,000	1.300000 2019/12/20	2.09
20	23 - 17 愛知県公債	日本	地方債証券	23,000,000	102.97 23,684,020	102.48 23,570,446	0.996000 2022/01/31	1.96
21	26 - 1 大分県公債	日本	地方債証券	21,700,000	102.92 22,333,857	103.05 22,362,826	0.539000 2024/10/31	1.86
22	340 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	103.74 20,749,400	104.76 20,952,800	0.400000 2025/09/20	1.75
23	336 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	103.94 20,788,400	104.67 20,934,600	0.500000 2024/12/20	1.74

24	334 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	104.14 20,828,800	104.66 20,932,000	0.600000 2024/06/20	1.74
25	344 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	101.88 20,377,600	103.47 20,695,200	0.100000 2026/09/20	1.72
26	328 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	103.19 20,638,600	103.37 20,674,600	0.600000 2023/03/20	1.72
27	26 - 3 千葉県公債	日本	地方債証券	20,000,000	103.19 20,638,900	103.24 20,649,740	0.611000 2024/07/25	1.72
28	734 東京都公債	日本	地方債証券	20,000,000	102.84 20,568,840	102.92 20,584,940	0.551000 2024/06/20	1.71
29	314 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	102.71 20,542,000	102.15 20,431,400	1.100000 2021/03/20	1.70
30	27 - 2 新潟県公債	日本	地方債証券	20,000,000	101.16 20,233,580	101.62 20,325,380	0.215000 2026/02/26	1.69

(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

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	50.59%
地方債証券	44.77%
合計	95.35%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

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

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

財形株式マザーファンド

(1) 投資状況（2019年8月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
---------	-------	---------

株式		739,144,560	98.30
	内 日本	739,144,560	98.30
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		12,800,300	1.70
純資産総額		751,944,860	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	12,080,000	1.61
	内 日本	12,080,000
		1.61

(注1) 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。

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該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、当該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) 投資資産 (2019年8月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 トヨタ自動車	日本	株式	輸送用 機器	3,800	6,730.97 25,577,720	6,960.00 26,448,000	3.52
2 ソニー	日本	株式	電気機 器	2,200	5,055.00 11,121,000	6,042.00 13,292,400	1.77
3 ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	2,700	4,226.00 11,410,200	4,824.00 13,024,800	1.73
4 キーエンス	日本	株式	電気機 器	200	60,100.00 12,020,000	62,900.00 12,580,000	1.67
5 日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	2,300	4,745.00 10,913,500	5,096.00 11,720,800	1.56
6 三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	22,000	578.80 12,733,600	510.40 11,228,800	1.49
7 武田薬品	日本	株式	医薬品	2,900	4,476.17 12,980,901	3,590.00 10,411,000	1.38
8 三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,400	3,985.30 9,564,740	3,484.00 8,361,600	1.11

9	任天堂	日本	株式	その他製品	200	32,260.00 6,452,000	40,290.00 8,058,000	1.07
10	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	2,400	2,969.50 7,126,800	3,219.00 7,725,600	1.03
11	KDDI	日本	株式	情報・通信業	2,700	2,680.04 7,236,128	2,835.00 7,654,500	1.02
12	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	48,500	174.67 8,471,500	154.70 7,502,950	1.00
13	第一三共	日本	株式	医薬品	1,000	3,948.00 3,948,000	7,018.00 7,018,000	0.93
14	本田技研	日本	株式	輸送用機器	2,700	3,132.00 8,456,400	2,523.50 6,813,450	0.91
15	ダイキン工業	日本	株式	機械	500	11,690.00 5,845,000	13,155.00 6,577,500	0.87
16	東京海上HD	日本	株式	保険業	1,200	5,392.00 6,470,400	5,472.00 6,566,400	0.87
17	信越化学	日本	株式	化学	600	9,202.00 5,521,200	10,715.00 6,429,000	0.85
18	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	300	23,980.00 7,194,000	21,015.00 6,304,500	0.84
19	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,400	3,121.89 7,492,540	2,585.00 6,204,000	0.83
20	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	400	11,570.00 4,628,000	15,470.00 6,188,000	0.82
21	花王	日本	株式	化学	800	7,720.00 6,176,000	7,674.00 6,139,200	0.82
22	資生堂	日本	株式	化学	700	6,731.00 4,711,700	8,690.00 6,083,000	0.81
23	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	600	10,280.00 6,168,000	10,115.00 6,069,000	0.81
24	HOYA	日本	株式	精密機器	700	6,568.00 4,597,600	8,649.00 6,054,300	0.81
25	日本電産	日本	株式	電気機器	400	13,025.00 5,210,000	13,855.00 5,542,000	0.74
26	ファナック	日本	株式	電気機器	300	18,615.00 5,584,500	18,455.00 5,536,500	0.74
27	日立	日本	株式	電気機器	1,500	3,525.00 5,287,500	3,629.00 5,443,500	0.72
28	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	2,000	2,605.00 5,210,000	2,682.00 5,364,000	0.71

29	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	1,400	4,776.00 6,686,400	3,757.00 5,259,800	0.70
30	ソフトバンク	日本	株式	情報・通 信業	3,500	1,348.43 4,719,505	1,490.50 5,216,750	0.69

(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

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.30%
合計	98.30%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
水産・農林業	0.13%
鉱業	0.24%
建設業	2.75%
食料品	3.91%
繊維製品	0.56%
パルプ・紙	0.20%
化学	7.12%
医薬品	5.63%
石油・石炭製品	0.54%
ゴム製品	0.79%
ガラス・土石製品	0.74%
鉄鋼	0.73%
非鉄金属	0.62%
金属製品	0.53%
機械	5.20%
電気機器	13.75%
輸送用機器	7.55%
精密機器	2.13%
その他製品	2.21%
電気・ガス業	1.71%
陸運業	4.82%
海運業	0.16%
空運業	0.46%
倉庫・運輸関連業	0.18%
情報・通信業	8.67%

卸売業	4.90%
小売業	4.62%
銀行業	5.64%
証券、商品先物取引業	0.88%
保険業	2.18%
その他金融業	1.15%
不動産業	2.43%
サービス業	5.15%
合計	98.30%

(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

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	ミニTOPIX先物 2019年9 月	買建	8	12,433,064	12,080,000	1.61%

(注1) 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。

(注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該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、当該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。

(参考情報) 運用実績

●財形株投(年金・住宅財形30)

2019年8月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,920円
純資産総額	5.7億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.9%
3カ月間	-0.1%
6カ月間	-1.9%
1年間	-4.1%
3年間	1.7%
5年間	3.0%
設定来	-0.1%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において運用管理費用(信託報酬)は控除しています。

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 65円

決算期	第14期	第15期	第16期	第17期	第18期	第19期	第20期	第21期	第22期	第23期	第24期	第25期
	08年2月	09年2月	10年2月	11年2月	12年2月	13年2月	14年2月	15年2月	16年2月	17年2月	18年2月	19年2月
分配金	5円	0円										

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	債券ポートフォリオ特性値	株式東証33業種別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	業種名	比率	
国内債券	55	64.8%	直接利回り(%)	電気機器	3.9%	トヨタ自動車	輸送用機器	1.0%	
国内株式・先物	671	28.2%	最終利回り(%)	情報・通信業	2.4%	ソニー	電気機器	0.5%	
			修正デュレーション	輸送用機器	2.1%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.5%	
コール・ローン、その他		7.5%	残存年数	化学	2.0%	キーエンス	電気機器	0.5%	
合計	726	-	債券格付別構成	銀行業	1.6%	ミニTPX先物 0109月	-	0.5%	
			AAA	53.1%	医薬品	1.6%	日本電信電話	情報・通信業	0.4%
株式 市場・上場別構成			AA	4.5%	機械	1.5%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	0.4%
一部(東証・名証)		27.7%	A	17.1%	サービス業	1.5%	武田薬品	医薬品	0.4%
二部(東証・名証)		-	BBB	-	卸売業	1.4%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	0.3%
新興市場他		-	BB以下・無格付	25.3%	その他	9.8%	任天堂	その他製品	0.3%
その他		-	合計	100.0%	合計	27.7%	合計	4.8%	
合計		27.7%	合計	100.0%	合計	27.7%	合計	4.8%	

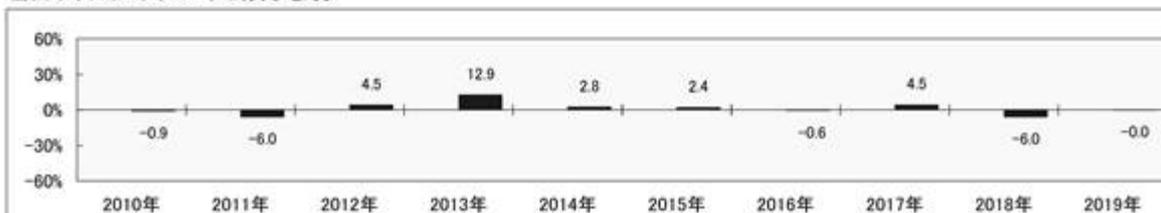
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を25.3%保有しております。

※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2019年は8月30日までの騰落率を表しています。

第2 【管理及び運営】

1 【申込(販売)手続等】

受益権の取得申込者は、事業主を通じて、販売会社取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドは、積立投資専用です。販売会社は、別に定める契約を結んだ取得申込者に対し、1,000円単位をもって受益権の取得の申込みに応じることができます。

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、原則として給与天引きで販売会社に支払うものとします。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。

なお、当ファンドにおいては、お買付申込受付日は、別に定める契約に定める日とします。

収益分配金を再投資する場合の受益権の価額は、原則として、各計算期間終了日の基準価額とします。

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、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、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なわれます。なお、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なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

2 【換金(解約)手続等】

受益者は、保有する受益権について、一部解約の実行を請求すること、または買取りを請求することにより換金することができます。

イ．一部解約

受益者は、自己に帰属する受益権について、1口単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引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付を中止することができます。一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、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、当該振替受益権の解約価額は、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たものとして、当該計算日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して4営業日目から受益者に支払います。

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

ロ．買取り

受益者が買取請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

販売会社は、受益者の請求があるときは、1口単位をもってその振替受益権を買取ります。

振替受益権の買取価額は、買取りの申込みを受けた日の基準価額から、当該買取りに関して課税対象者にかかる所得税および地方税に相当する金額を控除した額とします（当該課税対象者にかかる源泉徴収は、免除されることがあります。）。

受益者は、買取価額を、販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

販売会社は、金融商品取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、委託会社との協議に基づいて、振替受益権の買取りを中止することができます。振替受益権の買取りが中止された場合には、受益者は買取中止以前に行なった当日の買取請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の買取価額は、買取中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取りの申込みを受けたものとして、上記に準じて計算された価額とします。

<年金財形および住宅財形にかかる当ファンドの換金の取扱い>

1．年金財形の場合

年金財形については、年金の受取目的以外の換金は原則として認められません。

年金の受取りを目的として解約請求する場合には、解約代金（受取年金）に対して税金はかかりません（積立てられた元金および収益分配金の累計額が限度額（住宅財形との合計で550万円）以下である場合にかぎられます。）。この場合の1万口当たりの手取額は、解約価額とします。

年金の受取以外の目的で解約請求する場合には、原則として非課税の特典を失い、年金財形口座が全部解約となります。この場合の1万口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税が差引かれるほか、過去5年間にさかのぼり、その間に支払われた普通分配金に対して追徴課税されます。

2．住宅財形の場合

住宅財形については、住宅の取得等の費用にあてる場合以外の換金は原則としてできません。

住宅の取得等を目的として解約請求する場合には、解約代金に対して税金はかかりません（積立てられた元金および収益分配金の累計額が限度額（年金財形との合計で550万円）以下である場合にかぎられます。）。この場合の1万口当たりの手取額は、解約価額とします。

住宅の取得等以外の目的で解約請求する場合には、原則として非課税の特典を失い、住宅財形口座が全部解約となります。この場合の1万口当たりの手取額は、解約価額から所得税および地方税が差引かれるほか、過去5年間にさかのぼり、その間に支払われた普通分配金に対して追徴課税されま

す。

() 換金時の費用や税金については、「第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金」をご覧ください。

() くわしくはお勤め先の事務局等でご確認下さい。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、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信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたが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なわれます。

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をい

います。

純資産総額とは、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したがって時価（注1、注2）により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をいいます。

(注1) 当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。
- ・ 東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・ 内外の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
 2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
 3. 価格情報会社の提供する価額

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・ 東京証券取引所第一部上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・ 内外の公社債：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値（平均値）
 2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
 3. 価格情報会社の提供する価額

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。）、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電

信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問い合わせ先(委託会社)
電話番号(コールセンター) 0120-106212
(営業日の9:00~17:00)
- ・委託会社のホームページ
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

原則として、毎年2月2日から翌年2月1日までとします。

上記にかかわらず、上記による各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)もしくはその翌日が休業日である場合には、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日で、翌日が営業日である日のうち、該当日に最も近い日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、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出ます。
2. 委託会社は、前1.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信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかる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。
3. 前2.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。
4. 前3.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を超えるとときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、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。

6. 前3.から前5.までの規定は、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、前3.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なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 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、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、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信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかる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。
3. 前2.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。
4. 前3.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を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該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。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

前 の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前 の3.または前 の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、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取るべき旨を請求することができます。

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
 - ・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

公告

1. 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ない、次のアドレスに掲載します。

<https://www.daiwa-am.co.jp/>

2. 前1.の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。

関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

4 【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

収益分配金は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に再投資されます。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。

受益者は、償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に応じて請求する権利を有します。

償還金は、信託終了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（信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了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、）に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとし、

受益者が、信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

換金請求権

受益者は、保有する受益権について、一部解約の実行を請求すること、または買取りを請求することにより換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金（解約）手続等」をご参照下さい。

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）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25期計算期間（平成30年2月2日から平成31年2月4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】

【財務諸表】

財形株投（年金・住宅財形30）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第24期 平成30年2月1日現在	第25期 平成31年2月4日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	31,159,203	22,393,480
親投資信託受益証券	592,522,649	580,440,980
流動資産合計	623,681,852	602,834,460
資産合計	623,681,852	602,834,460
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	244,411	248,362
未払委託者報酬	4,546,440	4,620,100
その他未払費用	16,184	18,198
流動負債合計	4,807,035	4,886,660
負債合計	4,807,035	4,886,660
純資産の部		
元本等		
元本	1,582,780,750	1,593,434,746
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	36,094,067	4,513,054
（分配準備積立金）	67,172,369	62,651,055
元本等合計	618,874,817	597,947,800
純資産合計	618,874,817	597,947,800
負債純資産合計	623,681,852	602,834,460

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第24期		第25期	
	自	平成29年2月2日 至 平成30年2月1日	自	平成30年2月2日 至 平成31年2月4日
営業収益				
受取利息		-		8
有価証券売買等損益		39,975,456		22,081,669
営業収益合計		39,975,456		22,081,661
営業費用				
支払利息		15,245		9,069
受託者報酬		478,718		492,557
委託者報酬		8,905,472		9,162,981
その他費用		32,136		46,531
営業費用合計		9,431,571		9,711,138
営業利益又は営業損失（ ）		30,543,885		31,792,799
経常利益又は経常損失（ ）		30,543,885		31,792,799
当期純利益又は当期純損失（ ）		30,543,885		31,792,799
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（ ）		652,885		1,251,431
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,058,065		36,094,067
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,555,481		1,448,852
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,555,481		1,448,852
剰余金減少額又は欠損金増加額		410,479		2,488,497
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		410,479		2,488,497
分配金		1 -		1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		36,094,067		4,513,054

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第25期	
	自 平成30年2月2日	至 平成31年2月4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、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日 平成31年2月1日の翌日及びその翌々日が休日のため、当計算期間末日を平成31年2月4日としております。このため、当計算期間は368日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第24期	第25期
	平成30年2月1日現在	平成31年2月4日現在
1. 1 期首元本額	577,706,069円	582,780,750円
期中追加設定元本額	50,328,668円	51,449,630円
期中一部解約元本額	45,253,987円	40,795,634円
2. 計算期間末日における受益権の総数	582,780,750口	593,434,746口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第24期	第25期
	自 平成29年2月2日 至 平成30年2月1日	自 平成30年2月2日 至 平成31年2月4日

1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(29,897,226円)、投資信託約款に規定される収益調整金(74,653,784円)及び分配準備積立金(37,275,143円)より分配対象額は141,826,153円(1万口当たり2,433.61円)であり、分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(0円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(81,767,189円)及び分配準備積立金(62,651,055円)より分配対象額は144,418,244円(1万口当たり2,433.60円)であり、分配を行っておりません。
------------	---	--

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第25期 自 平成30年2月2日 至 平成31年2月4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	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。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、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、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	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
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

区 分	第25期
	平成31年2月4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. 金融商品の時価の算定方法	(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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	第24期	第25期
	平成30年2月1日現在	平成31年2月4日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	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	36,744,212	22,119,906
合計	36,744,212	22,119,906

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第24期	第25期
平成30年2月1日現在	平成31年2月4日現在
該当事項はありません。	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25期
自 平成30年2月2日
至 平成31年2月4日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、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、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第24期	第25期
	平成30年2月1日現在	平成31年2月4日現在
1口当たり純資産額	1.0619円	1.0076円

(1万口当たり純資産額)	(10,619円)	(10,076円)
--------------	-----------	-----------

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益 証券	財形公社債マザーファンド	301,483,347	402,269,229	
	財形株式マザーファンド	120,443,285	178,171,751	
親投資信託受益証券 合計			580,440,980	
合計			580,440,980	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 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)

当ファンドは、「財形公社債マザーファンド」受益証券及び「財形株式マザーファンド」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。

なお、当ファンドの計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「財形公社債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年2月1日現在	平成31年2月4日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		

コール・ローン		64,421,651	74,179,459
国債証券		812,080,505	657,022,320
地方債証券		418,121,382	513,965,935
未収利息		2,130,624	2,039,638
前払費用		46,925	92,333
流動資産合計		1,296,801,087	1,247,299,685
資産合計		1,296,801,087	1,247,299,685
負債の部			
流動負債			
その他未払費用		-	5,573
流動負債合計		-	5,573
負債合計		-	5,573
純資産の部			
元本等			
元本	1	976,026,659	934,780,675
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		320,774,428	312,513,437
元本等合計		1,296,801,087	1,247,294,112
純資産合計		1,296,801,087	1,247,294,112
負債純資産合計		1,296,801,087	1,247,299,685

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年2月2日 至 平成31年2月4日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び地方債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年2月1日現在	平成31年2月4日現在
1. 1 期首	平成29年2月2日	平成30年2月2日
期首元本額	930,942,666円	976,026,659円
期中追加設定元本額	45,083,993円	- 円
期中一部解約元本額	- 円	41,245,984円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
財形株投（一般財形50）	377,599,240円	355,100,917円
財形株投（一般財形30）	289,446,696円	278,196,411円
財形株投（年金・住宅財形30）	308,980,723円	301,483,347円
計	976,026,659円	934,780,675円
2. 期末日における受益権の総数	976,026,659口	934,780,675口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年2月2日 至 平成31年2月4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	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、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	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
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

区 分	平成31年2月4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. 金融商品の時価の算定方法	(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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成30年2月1日現在	平成31年2月4日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	5,746,425	2,280,485
地方債証券	2,260,210	1,022,942
合計	8,006,635	3,303,427

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年2月2日から平成30年2月1日まで、及び平成30年2月2日から平成31年2月4日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成30年2月1日現在	平成31年2月4日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成30年2月1日現在	平成31年2月4日現在
1口当たり純資産額	1.3287円	1.3343円
（1万口当たり純資産額）	（13,287円）	（13,343円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	2 9 9 1 0 年国債	30,000,000	30,052,200	
	3 0 1 1 0 年国債	20,000,000	20,124,600	
	3 0 3 1 0 年国債	30,000,000	30,297,000	
	3 0 5 1 0 年国債	25,000,000	25,325,000	
	3 0 6 1 0 年国債	1,000,000	1,017,750	
	3 0 9 1 0 年国債	20,000,000	20,351,400	
	3 1 0 1 0 年国債	35,000,000	35,671,650	
	3 1 2 1 0 年国債	25,000,000	25,645,250	
	3 1 4 1 0 年国債	20,000,000	20,542,000	
	3 1 5 1 0 年国債	25,000,000	25,818,000	
	3 1 8 1 0 年国債	30,000,000	30,924,300	
	3 2 0 1 0 年国債	10,000,000	10,337,500	
	3 2 1 1 0 年国債	10,000,000	10,366,700	
	3 2 3 1 0 年国債	15,000,000	15,543,900	
	3 2 4 1 0 年国債	5,000,000	5,164,350	
	3 2 5 1 0 年国債	35,000,000	36,237,250	
	3 2 8 1 0 年国債	20,000,000	20,638,600	
	3 2 9 1 0 年国債	10,000,000	10,427,000	
	3 3 0 1 0 年国債	5,000,000	5,224,700	
	3 3 2 1 0 年国債	27,000,000	28,014,120	
	3 3 3 1 0 年国債	10,000,000	10,394,800	
	3 3 4 1 0 年国債	20,000,000	20,828,800	
	3 3 6 1 0 年国債	20,000,000	20,788,400	
	3 3 9 1 0 年国債	30,000,000	31,080,900	
3 4 0 1 0 年国債	20,000,000	20,749,400		
3 4 3 1 0 年国債	30,000,000	30,570,300		
3 4 4 1 0 年国債	20,000,000	20,377,600		
3 4 5 1 0 年国債	40,000,000	40,747,600		
1 7 物価連動国債	50,000,000	53,761,250		
国債証券 合計			657,022,320	
地方債証券	7 3 4 東京都公債	20,000,000	20,568,840	
	7 3 6 東京都公債	50,000,000	51,350,900	
	3 4 9 大阪府公債	10,000,000	10,307,690	
	3 7 7 大阪府公債	9,000,000	9,300,042	
	3 8 4 大阪府公債	10,000,000	10,332,320	

3 8 6 大阪府公債	30,000,000	30,882,540	
2 3 - 4 京都府公債	9,000,000	9,257,202	
2 3 - 1 7 愛知県公債	23,000,000	23,684,020	
2 4 - 1 3 愛知県公債	27,000,000	27,789,696	
2 1 - 1 1 千葉県公債	20,000,000	20,277,000	
2 1 - 1 2 千葉県公債	19,000,000	19,289,902	
2 6 - 3 千葉県公債	20,000,000	20,638,900	
1 千葉県20年	10,000,000	11,381,060	
2 3 - 2 新潟県公債	10,000,000	10,308,530	
2 7 - 2 新潟県公債	20,000,000	20,233,580	
2 6 - 1 大分県公債	21,700,000	22,333,857	
2 7 - 2 熊本県公債	27,690,000	28,495,086	
2 0 - 4 京都市公債	10,000,000	10,007,920	
2 4 - 2 京都市公債	9,000,000	9,270,702	
2 6 - 1 横浜市ハマ債5	14,000,000	14,008,260	
2 3 - 6 札幌市公債	10,000,000	10,264,850	
2 4 - 1 0 札幌市公債	25,000,000	25,768,800	
2 7 - 2 北九州市債	11,800,000	12,154,696	
2 4 - 4 福岡市公債	32,000,000	32,949,280	
2 5 - 4 福岡市公債	15,000,000	15,473,175	
1 2 さいたま市公債	10,000,000	10,249,770	
2 4 - 1 三重県公債	17,600,000	18,120,449	
2 3 - 1 岡山市公債	9,000,000	9,266,868	
地方債証券 合計		513,965,935	
合計		1,170,988,255	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 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。

「財形株式マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年2月1日現在	平成31年2月4日現在
	金額(円)	金額(円)

資産の部		
流動資産		
コール・ローン	21,010,687	14,602,821
株式	866,493,300	806,256,520
派生商品評価勘定	88,242	1,554,420
未収配当金	1,117,050	1,204,111
前払金	332,400	-
差入委託証拠金	465,000	465,000
流動資産合計	889,506,679	824,082,872
資産合計	889,506,679	824,082,872
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	151,722	-
前受金	-	1,365,500
未払金	1,946,699	-
その他未払費用	-	2,063
流動負債合計	2,098,421	1,367,563
負債合計	2,098,421	1,367,563
純資産の部		
元本等		
元本	1	518,859,037
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		368,549,221
元本等合計		887,408,258
純資産合計		887,408,258
負債純資産合計		824,082,872

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年2月2日 至 平成31年2月4日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な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. デリバティブ取引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。</p> <p>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又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</p> <p>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>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年2月1日現在	平成31年2月4日現在
1. 1 期首	平成29年2月2日	平成30年2月2日
期首元本額	609,161,164円	518,859,037円
期中追加設定元本額	- 円	48,796,941円
期中一部解約元本額	90,302,127円	11,512,282円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
財形株投（一般財形50）	313,548,556円	324,689,464円
財形株投（一般財形30）	98,908,117円	111,010,947円
財形株投（年金・住宅財形	106,402,364円	120,443,285円
30）		
計	518,859,037円	556,143,696円
2. 期末日における受益権の総数	518,859,037口	556,143,696口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年2月2日 至 平成31年2月4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	当ファンドが保有す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等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
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。 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

区 分	平成31年2月4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. 金融商品の時価の算定方法	(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 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成30年2月1日現在	平成31年2月4日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	154,485,920	120,372,792
合計	154,485,920	120,372,792

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年2月2日から平成30年2月1日まで、及び平成30年2月2日から平成31年2月4日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

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

種 類	平成30年2月1日 現在				平成31年2月4日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	18,727,400	-	18,665,000	62,400	14,249,500	-	15,805,000	1,555,500
合計	18,727,400	-	18,665,000	62,400	14,249,500	-	15,805,000	1,555,500

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として期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又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期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おります。

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。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成30年2月1日現在	平成31年2月4日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7103円 (17,103円)	1.4793円 (14,793円)
---------------------------	----------------------	----------------------

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額(円)		備考
		単価	金額	
日本水産	600	673.00	403,800	
マル八二チロ	100	3,740.00	374,000	
サカタのタネ	100	3,670.00	367,000	
ミライト・ホールディングス	200	1,617.00	323,400	
国際石油開発帝石	2,000	1,046.00	2,092,000	
安藤・間	400	741.00	296,400	
コムシスホールディングス	200	2,871.00	574,200	
大成建設	400	5,200.00	2,080,000	
大林組	1,200	1,053.00	1,263,600	
清水建設	1,200	950.00	1,140,000	
飛島建設	400	1,463.00	585,200	
長谷工コーポレーション	500	1,218.00	609,000	
鹿島建設	900	1,567.00	1,410,300	
鉄建建設	200	2,675.00	535,000	
西松建設	100	2,567.00	256,700	
三井住友建設	500	701.00	350,500	
大豊建設	100	3,500.00	350,000	
前田建設	300	1,112.00	333,600	
奥村組	100	3,545.00	354,500	
東鉄工業	100	2,979.00	297,900	
戸田建設	500	717.00	358,500	
熊谷組	100	3,505.00	350,500	
大東建託	200	15,055.00	3,011,000	
前田道路	200	2,184.00	436,800	
五洋建設	600	641.00	384,600	
住友林業	300	1,437.00	431,100	
大和ハウス	1,100	3,447.00	3,791,700	
ライト工業	300	1,357.00	407,100	
積水ハウス	1,100	1,626.50	1,789,150	

きんでん	300	1,812.00	543,600
協和エクシオ	200	2,737.00	547,400
九電工	100	3,945.00	394,500
三機工業	300	1,155.00	346,500
日揮	400	1,641.00	656,400
高砂熱学	100	1,761.00	176,100
大気社	100	2,876.00	287,600
日比谷総合設備	200	1,754.00	350,800
東芝プラントシステム	100	2,033.00	203,300
日清製粉G本社	300	2,224.00	667,200
昭和産業	100	2,950.00	295,000
日本甜菜糖	200	1,754.00	350,800
日本M&Aセンター	300	2,718.00	815,400
エス・エム・エス	200	1,821.00	364,200
パーソルホールディングス	400	1,997.00	798,800
森永製菓	100	4,520.00	452,000
江崎グリコ	100	5,430.00	543,000
山崎製パン	300	2,166.00	649,800
寿スピリッツ	100	4,110.00	411,000
カルビー	100	3,465.00	346,500
ヤクルト	300	7,280.00	2,184,000
明治ホールディングス	300	8,480.00	2,544,000
雪印メグミルク	100	2,897.00	289,700
日本ハム	100	4,235.00	423,500
丸大食品	200	1,814.00	362,800
S Foods	100	3,970.00	397,000
システナ	200	1,313.00	262,600
新日鉄住金SOL	100	3,150.00	315,000
総合警備保障	100	4,870.00	487,000
カカクコム	300	1,908.00	572,400
エムスリー	800	1,628.00	1,302,400
アウトソーシング	300	1,287.00	386,100
ディー・エヌ・エー	200	1,839.00	367,800
博報堂DYHLDGS	500	1,691.00	845,500
インフォマート	300	1,200.00	360,000
サッポロホールディングス	100	2,507.00	250,700
アサヒグループホールディング	800	4,604.00	3,683,200
麒麟HD	1,600	2,675.00	4,280,000
宝ホールディングス	400	1,244.00	497,600
オエノンホールディングス	1,100	360.00	396,000

コカ・コーラボトラーズJHD	300	3,455.00	1,036,500
サントリー食品インター	200	4,935.00	987,000
伊藤園	100	5,060.00	506,000
キーコーヒー	200	2,040.00	408,000
J-オイルミルズ	100	3,885.00	388,500
ローソン	100	6,750.00	675,000
カワチ薬品	200	2,190.00	438,000
エービーシー・マート	100	6,360.00	636,000
ゲオホールディングス	200	1,672.00	334,400
エディオン	300	1,013.00	303,900
双日	2,100	419.00	879,900
アルフレッサホールディングス	400	3,040.00	1,216,000
キッコーマン	300	5,500.00	1,650,000
味の素	700	1,673.50	1,171,450
キューピー	200	2,477.00	495,400
ハウス食品G本社	100	4,085.00	408,500
カゴメ	100	2,920.00	292,000
ニチレイ	200	2,911.00	582,200
横浜冷凍	500	929.00	464,500
東洋水産	200	3,910.00	782,000
日清食品HD	100	7,040.00	704,000
フジッコ	100	2,241.00	224,100
日本たばこ産業	2,000	2,754.00	5,508,000
ユーグレナ	500	603.00	301,500
ヒューリック	800	1,005.00	804,000
クオールホールディングス	100	1,505.00	150,500
神戸物産	100	3,480.00	348,000
ビックカメラ	300	1,288.00	386,400
MonotaRO	300	2,513.00	753,900
あいホールディングス	100	1,957.00	195,700
J.フロントリテイリング	400	1,263.00	505,200
ドトール・日レスHD	200	2,113.00	422,600
マツモトキヨシHLDS	200	3,470.00	694,000
ZOZO	400	2,030.00	812,000
ココカラファイン	100	5,010.00	501,000
三越伊勢丹HD	600	1,104.00	662,400
シキボウ	800	1,051.00	840,800
トヨタ紡織	100	1,764.00	176,400
ウエルシアHD	100	4,155.00	415,500
バイタルKSKHD	300	1,112.00	333,600

すかいらーくHD	500	1,830.00	915,000
日本毛織	400	885.00	354,000
野村不動産HLDGS	200	2,104.00	420,800
ユニゾホールディングス	100	2,157.00	215,700
オープンハウス	100	4,600.00	460,000
東急不動産HD	1,100	600.00	660,000
飯田GHD	300	2,018.00	605,400
シップヘルスケアHD	100	4,130.00	413,000
セブン&アイ・HLDGS	1,500	4,776.00	7,164,000
ツルハホールディングス	100	10,160.00	1,016,000
帝人	200	1,844.00	368,800
東レ	2,600	802.10	2,085,460
クラレ	500	1,686.00	843,000
旭化成	2,500	1,206.50	3,016,250
SUMCO	500	1,507.00	753,500
コメダホールディングス	300	2,100.00	630,000
スシローグローバルHLDGS	100	6,680.00	668,000
ホギメディカル	100	3,725.00	372,500
TIS	100	5,150.00	515,000
ネクソン	900	1,713.00	1,541,700
アイスタイル	200	865.00	173,000
特種東海製紙	100	3,915.00	391,500
GMOペイメントゲートウェイ	100	5,660.00	566,000
インターネットイニシアティブ	200	2,624.00	524,800
王子ホールディングス	1,500	630.00	945,000
LINE	100	3,970.00	397,000
レンゴー	500	956.00	478,000
昭和電工	300	3,750.00	1,125,000
住友化学	2,600	559.00	1,453,400
日産化学	200	5,720.00	1,144,000
日本曹達	100	2,772.00	277,200
東ソー	600	1,591.00	954,600
トクヤマ	100	2,645.00	264,500
セントラル硝子	100	2,523.00	252,300
大阪ソーダ	200	2,512.00	502,400
デンカ	100	3,455.00	345,500
イビデン	200	1,594.00	318,800
信越化学	600	9,202.00	5,521,200
エア・ウォーター	300	1,851.00	555,300
大陽日酸	300	1,745.00	523,500

日本パ - カライジング	200	1,311.00	262,200
日本触媒	100	7,230.00	723,000
大日精化	100	2,951.00	295,100
カネカ	100	4,275.00	427,500
協和発酵キリン	400	2,113.00	845,200
三菱瓦斯化学	400	1,731.00	692,400
三井化学	300	2,719.00	815,700
J S R	400	1,798.00	719,200
三菱ケミカルH L D G S	2,300	933.50	2,147,050
K H ネオケム	100	2,550.00	255,000
ダイセル	500	1,095.00	547,500
住友ベ - クライト	100	4,080.00	408,000
積水化学	700	1,709.00	1,196,300
日本ゼオン	300	1,140.00	342,000
アイカ工業	100	3,895.00	389,500
宇部興産	200	2,449.00	489,800
日立化成	200	1,946.00	389,200
日本化薬	200	1,300.00	260,000
E P S ホールディングス	100	1,700.00	170,000
野村総合研究所	200	4,415.00	883,000
ケネディクス	700	598.00	418,600
電通	400	5,260.00	2,104,000
日油	200	3,725.00	745,000
花 王	900	7,720.00	6,948,000
武田薬品	2,300	4,453.00	10,241,900
アステラス製薬	3,300	1,750.00	5,775,000
大日本住友製薬	300	2,680.00	804,000
塩野義製薬	500	6,858.00	3,429,000
田辺三菱製薬	400	1,733.00	693,200
日本新薬	100	7,300.00	730,000
中外製薬	400	6,850.00	2,740,000
科研製薬	100	5,400.00	540,000
エーザイ	400	8,876.00	3,550,400
ロート製薬	200	3,015.00	603,000
小野薬品	800	2,337.50	1,870,000
久光製薬	100	5,730.00	573,000
参天製薬	600	1,541.00	924,600
ツムラ	100	3,255.00	325,500
テ ル モ	500	6,230.00	3,115,000
みらかホールディングス	100	2,775.00	277,500

生化学工業	200	1,255.00	251,000
栄研化学	100	2,522.00	252,200
沢井製薬	100	5,630.00	563,000
ゼリア新薬工業	200	1,848.00	369,600
第一三共	1,100	3,948.00	4,342,800
キョーリン製薬HD	100	2,330.00	233,000
大塚ホールディングス	700	4,557.00	3,189,900
大正製薬HD	100	11,500.00	1,150,000
ペプチドリーム	200	4,730.00	946,000
日本ペイントHOLD	300	3,690.00	1,107,000
関西ペイント	400	1,918.00	767,200
中国塗料	300	982.00	294,600
D I C	200	3,495.00	699,000
サカタインクス	200	1,236.00	247,200
オリエンタルランド	400	11,570.00	4,628,000
ダスキン	200	2,581.00	516,200
パーク24	200	2,671.00	534,200
明光ネットワークジャパン	400	940.00	376,000
フジ・メディア・HD	400	1,596.00	638,400
オービック	100	10,440.00	1,044,000
ヤフー	2,700	294.00	793,800
ビー・エム・エル	100	3,075.00	307,500
トレンドマイクロ	200	5,820.00	1,164,000
日本オラクル	100	8,090.00	809,000
ユー・エス・エス	400	1,946.00	778,400
伊藤忠テクノソリュー	200	2,636.00	527,200
サイバーエージェント	200	3,450.00	690,000
楽天	1,700	809.00	1,375,300
大塚商会	200	4,240.00	848,000
デジタルガレージ	100	2,609.00	260,900
エン・ジャパン	100	4,270.00	427,000
富士フイルムHLDGS	700	4,622.00	3,235,400
コニカミノルタ	800	1,009.00	807,200
資生堂	700	6,731.00	4,711,700
ライオン	500	2,335.00	1,167,500
高砂香料	100	3,540.00	354,000
ミルボン	100	4,585.00	458,500
ファンケル	200	2,467.00	493,400
コーセー	100	16,420.00	1,642,000
ポーラ・オルビスHD	200	3,285.00	657,000

コニシ	400	1,748.00	699,200
小林製薬	100	8,230.00	823,000
荒川化学工業	200	1,371.00	274,200
タカラバイオ	100	2,450.00	245,000
昭和シェル石油	400	1,660.00	664,000
出光興産	300	3,920.00	1,176,000
JXTGホールディングス	6,200	595.40	3,691,480
コスモエネルギーHLDGS	100	2,529.00	252,900
横浜ゴム	200	2,335.00	467,000
TOYO TIRE	200	1,531.00	306,200
ブリヂストン	1,100	4,236.00	4,659,600
住友ゴム	300	1,506.00	451,800
オカモト	100	5,740.00	574,000
三ツ星ベルト	100	2,128.00	212,800
バンドー化学	300	1,123.00	336,900
AGC	300	3,715.00	1,114,500
日本板硝子	300	921.00	276,300
日本電気硝子	200	2,981.00	596,200
住友大阪セメント	100	4,850.00	485,000
太平洋セメント	200	3,790.00	758,000
東海カーボン	400	1,545.00	618,000
ノリタケ	100	5,200.00	520,000
TOTO	300	4,245.00	1,273,500
日本碍子	400	1,648.00	659,200
日本特殊陶業	300	2,288.00	686,400
ニチアス	100	1,958.00	195,800
新日鐵住金	1,500	2,010.50	3,015,750
神戸製鋼所	600	869.00	521,400
JFEホールディングス	1,000	1,940.00	1,940,000
東京製鐵	300	921.00	276,300
大和工業	100	2,900.00	290,000
淀川製鋼所	100	2,319.00	231,900
丸一鋼管	100	3,500.00	350,000
大同特殊鋼	100	4,475.00	447,500
山陽特殊製鋼	100	2,282.00	228,200
日立金属	400	1,087.00	434,800
日本製鋼所	100	2,070.00	207,000
三井金属	100	2,555.00	255,500
三菱マテリアル	200	3,075.00	615,000
住友鋁山	500	3,126.00	1,563,000

DOWAホールディングス	100	3,475.00	347,500	
古河電工	100	3,260.00	326,000	
住友電工	1,200	1,555.00	1,866,000	
フジクラ	700	469.00	328,300	
アサヒHD	200	2,127.00	425,400	
東洋製罐グループHD	200	2,465.00	493,000	
横河ブリッジHLDGS	200	2,043.00	408,600	
三和ホールディングス	300	1,291.00	387,300	
三協立山	200	1,405.00	281,000	
LIXILグループ	500	1,628.00	814,000	
ノーリツ	200	1,521.00	304,200	
リンナイ	100	7,380.00	738,000	
ユニプレス	200	2,111.00	422,200	
パイオラックス	100	2,246.00	224,600	
日本発条	400	1,039.00	415,600	
三浦工業	200	2,736.00	547,200	
タクマ	200	1,402.00	280,400	
テクノプロ・ホールディング	100	6,200.00	620,000	
リクルートホールディングス	2,500	2,969.50	7,423,750	
オークマ	100	5,900.00	590,000	
アマダホールディングス	400	1,097.00	438,800	
牧野フライス	100	4,355.00	435,500	
オーエスジー	200	2,270.00	454,000	
旭ダイヤモンド	500	737.00	368,500	
DMG森精機	300	1,494.00	448,200	
ソディック	400	829.00	331,600	
ディスコ	100	15,970.00	1,597,000	
日本郵政	2,700	1,348.00	3,639,600	
豊田自動織機	300	5,620.00	1,686,000	
ナブテスコ	200	2,892.00	578,400	
SMC	100	36,700.00	3,670,000	
ホソカワミクロン	100	4,470.00	447,000	
オイレス工業	200	1,867.00	373,400	
サト-ホールディングス	100	2,573.00	257,300	
技研製作所	100	3,275.00	327,500	
小松製作所	1,600	2,745.00	4,392,000	
住友重機械	200	3,755.00	751,000	
日立建機	200	2,804.00	560,800	
クボタ	1,900	1,728.50	3,284,150	
月島機械	200	1,416.00	283,200	

新東工業	400	956.00	382,400
渋谷工業	100	3,725.00	372,500
荏原製作所	200	3,045.00	609,000
千代田化工建	700	345.00	241,500
ダイキン工業	500	11,690.00	5,845,000
栗田工業	200	2,794.00	558,800
椿本チエイン	100	4,095.00	409,500
アネスト岩田	400	965.00	386,000
ダイフク	200	5,570.00	1,114,000
C K D	300	1,028.00	308,400
平和	100	2,347.00	234,700
S A N K Y O	100	4,270.00	427,000
ア マ ノ	200	2,308.00	461,600
ブラザー工業	500	1,895.00	947,500
モリタホールディングス	100	1,841.00	184,100
グローリー	100	2,689.00	268,900
セガサミーホールディングス	400	1,552.00	620,800
リ ケ ン	100	5,090.00	509,000
T P R	100	2,381.00	238,100
ツバキ・ナカシマ	100	1,747.00	174,700
ホシザキ	100	7,780.00	778,000
日本精工	700	1,072.00	750,400
ジェイテクト	300	1,374.00	412,200
不 二 越	100	4,330.00	433,000
ミネベアミツミ	700	1,779.00	1,245,300
T H K	300	2,655.00	796,500
キッツ	400	906.00	362,400
日 立	1,500	3,525.00	5,287,500
三菱電機	3,500	1,406.50	4,922,750
富士電機	200	3,365.00	673,000
安川電機	400	3,080.00	1,232,000
明 電 舎	200	1,636.00	327,200
マキタ	400	3,980.00	1,592,000
マブチモーター	100	3,880.00	388,000
日本電産	400	13,025.00	5,210,000
ダイヘン	200	2,557.00	511,400
J V C ケンウッド	1,200	286.00	343,200
オムロン	400	4,675.00	1,870,000
日東工業	200	2,237.00	447,400
ジーエス・ユアサ コーポ	100	2,308.00	230,800

日本電気	500	3,760.00	1,880,000
富士通	300	7,504.00	2,251,200
沖電気	300	1,272.00	381,600
ルネサスエレクトロニクス	600	637.00	382,200
セイコーエプソン	500	1,648.00	824,000
ワコム	600	485.00	291,000
アルバック	100	3,625.00	362,500
日本信号	300	972.00	291,600
パナソニック	4,100	1,061.00	4,350,100
シャープ	500	1,314.00	657,000
アンリツ	300	2,097.00	629,100
ソニー	2,400	5,055.00	12,132,000
T D K	200	8,570.00	1,714,000
アルプスアルパイン	400	2,285.00	914,000
フオスタ - 電機	200	1,663.00	332,600
ヒロセ電機	100	11,820.00	1,182,000
横河電機	300	2,046.00	613,800
アズビル	200	2,350.00	470,000
日本光電工業	200	3,570.00	714,000
堀場製作所	100	5,410.00	541,000
アドバンテスト	300	2,505.00	751,500
キーエンス	200	60,100.00	12,020,000
シスメックス	300	6,257.00	1,877,100
デンソー	800	4,818.00	3,854,400
オブテックスグループ	100	1,975.00	197,500
レーザーテック	100	3,640.00	364,000
スタンレー電気	300	3,240.00	972,000
ウシオ電機	200	1,275.00	255,000
日本セラミック	100	2,603.00	260,300
カシオ	400	1,500.00	600,000
ファナック	300	18,615.00	5,584,500
ローム	200	7,330.00	1,466,000
浜松ホトニクス	300	3,895.00	1,168,500
京セラ	500	5,912.00	2,956,000
太陽誘電	200	2,066.00	413,200
村田製作所	400	16,780.00	6,712,000
双葉電子工業	200	1,735.00	347,000
日東電工	300	6,054.00	1,816,200
東海理化電機	100	1,935.00	193,500
ニチコン	400	889.00	355,600

三井E & S H D	200	1,248.00	249,600
日立造船	700	362.00	253,400
三菱重工業	600	4,234.00	2,540,400
川崎重工業	300	2,736.00	820,800
I H I	300	3,420.00	1,026,000
名村造船所	600	444.00	266,400
F P G	300	1,057.00	317,100
全国保証	100	3,860.00	386,000
めぶきフィナンシャルG	1,700	303.00	515,100
東京きらぼしF G	200	1,542.00	308,400
九州フィナンシャルG	800	442.00	353,600
かんぼ生命保険	100	2,521.00	252,100
ゆうちょ銀行	800	1,260.00	1,008,000
コンコルディア・フィナンシャル	2,200	442.00	972,400
西日本フィナンシャルH D	300	981.00	294,300
日産自動車	4,300	933.30	4,013,190
いすゞ自動車	1,200	1,589.00	1,906,800
トヨタ自動車	4,000	6,726.00	26,904,000
日野自動車	400	1,035.00	414,000
三菱自動車工業	1,300	651.00	846,300
新明和工業	200	1,485.00	297,000
極東開発工業	200	1,559.00	311,800
トピー工業	100	2,435.00	243,500
タチエス	300	1,527.00	458,100
N O K	200	1,806.00	361,200
プレス工業	600	617.00	370,200
太平洋工業	200	1,765.00	353,000
ケーヒン	100	1,977.00	197,700
アイシン精機	300	4,350.00	1,305,000
マ ッ ダ	1,000	1,219.00	1,219,000
本田技研	3,000	3,132.00	9,396,000
スズキ	700	5,714.00	3,999,800
S U B A R U	1,100	2,552.50	2,807,750
ヤマハ発動機	500	2,348.00	1,174,000
小糸製作所	200	6,480.00	1,296,000
ミツバ	300	681.00	204,300
豊田合成	100	2,380.00	238,000
エフ・シー・シー	100	2,562.00	256,200
シマノ	200	15,520.00	3,104,000
テイ・エス テック	100	3,410.00	341,000

第四北越フィナンシャルG	100	3,140.00	314,000	
第一興商	100	5,270.00	527,000	
メディバルHD	300	2,608.00	782,400	
コーナン商事	200	2,771.00	554,200	
ネットワンシステムズ	200	2,526.00	505,200	
パンパシフィックHD	300	6,460.00	1,938,000	
ゼンショーホールディングス	200	2,529.00	505,800	
ユニテッドアローズ	100	3,755.00	375,500	
ハイデイ日高	100	2,172.00	217,200	
コロワイド	200	2,397.00	479,400	
スギホールディングス	100	4,615.00	461,500	
島津製作所	500	2,524.00	1,262,000	
スター精密	200	1,594.00	318,800	
東京精密	200	3,210.00	642,000	
マニー	100	4,855.00	485,500	
ニコン	600	1,878.00	1,126,800	
トプコン	200	1,549.00	309,800	
オリンパス	500	4,580.00	2,290,000	
SCREENホールディングス	100	4,460.00	446,000	
HOYA	700	6,568.00	4,597,600	
朝日インテック	100	4,990.00	499,000	
キヤノン	1,900	3,173.00	6,028,700	
リコー	1,200	1,150.00	1,380,000	
パラマウントベッドHD	100	4,650.00	465,000	
前田工織	100	2,666.00	266,600	
バンダイナムコHLDGS	400	4,875.00	1,950,000	
パイロットコーポレーション	100	5,390.00	539,000	
エイベックス	300	1,496.00	448,800	
フジシールインターナショナル	100	3,785.00	378,500	
タカラトミー	300	1,172.00	351,600	
凸版印刷	400	1,803.00	721,200	
大日本印刷	500	2,546.00	1,273,000	
アシックス	400	1,595.00	638,000	
ヤマハ	200	4,805.00	961,000	
ビジョン	200	4,340.00	868,000	
任天堂	200	32,260.00	6,452,000	
コクヨ	200	1,645.00	329,000	
ニフコ	100	2,815.00	281,500	
オカムラ	200	1,439.00	287,800	
伊藤忠	2,500	1,982.00	4,955,000	

丸 紅	3,400	843.10	2,866,540	
豊田通商	300	3,470.00	1,041,000	
兼 松	200	1,337.00	267,400	
ユニー・ファミリーマートHD	100	13,350.00	1,335,000	
三井物産	2,900	1,759.50	5,102,550	
日本紙パルプ	100	3,995.00	399,500	
東京エレクトロン	200	15,730.00	3,146,000	
日立ハイテクノロジーズ	100	4,100.00	410,000	
スターゼン	100	3,635.00	363,500	
セイコーHD	100	2,320.00	232,000	
山 善	300	1,130.00	339,000	
住友商事	2,100	1,684.50	3,537,450	
日本ユニシス	200	2,911.00	582,200	
三菱商事	2,500	3,126.00	7,815,000	
キヤノンマーケティングJPN	200	2,063.00	412,600	
ユアサ商事	100	3,335.00	333,500	
神鋼商事	100	2,612.00	261,200	
阪和興業	100	3,065.00	306,500	
ニプロ	300	1,453.00	435,900	
岩谷産業	100	3,740.00	374,000	
昭光通商	1,100	640.00	704,000	
三愛石油	200	979.00	195,800	
稲畑産業	200	1,489.00	297,800	
ユニ・チャーム	700	3,371.00	2,359,700	
デサント	100	2,605.00	260,500	
ワ キ タ	300	1,162.00	348,600	
ヤマトインタ - ナショナル	1,100	411.00	452,100	
サンリオ	100	2,265.00	226,500	
モスフード サービス	200	2,765.00	553,000	
加賀電子	100	2,073.00	207,300	
木曽路	200	2,485.00	497,000	
上新電機	100	2,320.00	232,000	
日本瓦斯	100	4,125.00	412,500	
ロイヤルホールディングス	100	2,670.00	267,000	
島 忠	100	3,095.00	309,500	
リンガーハット	200	2,351.00	470,200	
しまむら	100	9,490.00	949,000	
高 島 屋	300	1,483.00	444,900	
エイチ・ツー・オーリテイリング	200	1,604.00	320,800	
丸井グループ	400	2,214.00	885,600	

クレディセゾン	200	1,429.00	285,800
アクシアル リテイリング	100	3,390.00	339,000
イオン	1,500	2,274.00	3,411,000
イズミ	100	5,530.00	553,000
ケースホールディングス	500	1,106.00	553,000
PALTAC	100	5,300.00	530,000
新生銀行	300	1,455.00	436,500
あおぞら銀行	200	3,120.00	624,000
三菱UFJフィナンシャルG	24,700	578.80	14,296,360
りそなホールディングス	4,100	534.80	2,192,680
三井住友トラストHD	700	4,126.00	2,888,200
三井住友フィナンシャルG	2,500	3,983.00	9,957,500
千葉銀行	1,200	661.00	793,200
青森銀行	100	2,760.00	276,000
山形銀行	100	1,907.00	190,700
岩手銀行	100	3,240.00	324,000
東邦銀行	900	311.00	279,900
ふくおかフィナンシャルG	300	2,309.00	692,700
静岡銀行	800	880.00	704,000
スルガ銀行	300	476.00	142,800
八十二銀行	600	467.00	280,200
福井銀行	200	1,594.00	318,800
百五銀行	700	393.00	275,100
京都銀行	100	4,560.00	456,000
広島銀行	400	628.00	251,200
大分銀行	100	3,320.00	332,000
宮崎銀行	100	2,762.00	276,200
佐賀銀行	200	1,715.00	343,000
十八銀行	100	2,551.00	255,100
沖縄銀行	100	3,140.00	314,000
琉球銀行	400	1,122.00	448,800
セブン銀行	1,200	345.00	414,000
みずほフィナンシャルG	47,700	174.80	8,337,960
山口フィナンシャルG	300	1,117.00	335,100
芙蓉総合リース	100	5,500.00	550,000
興銀リース	100	2,551.00	255,100
東京センチュリー	100	5,110.00	511,000
SBIホールディングス	500	2,197.00	1,098,500
日本証券金融	500	612.00	306,000
アイフル	1,100	286.00	314,600

名古屋銀行	100	3,180.00	318,000
栃木銀行	1,700	233.00	396,100
イオンフィナンシャルサービス	200	2,104.00	420,800
アコム	800	383.00	306,400
ジャックス	100	1,901.00	190,100
オリックス	2,400	1,649.50	3,958,800
三菱UFJリース	700	560.00	392,000
ジャフコ	100	3,790.00	379,000
トモニホールディングス	900	404.00	363,600
大和証券G本社	2,600	553.10	1,438,060
野村ホールディングス	6,200	442.20	2,741,640
岡三証券グループ	500	485.00	242,500
丸三証券	700	801.00	560,700
東海東京HD	700	487.00	340,900
いちよし証券	500	879.00	439,500
SOMPOホールディングス	700	4,124.00	2,886,800
日本取引所グループ	900	1,922.00	1,729,800
マネックスG	600	375.00	225,000
フィデアホール	4,800	137.00	657,600
池田泉州HD	800	298.00	238,400
MS&AD	900	3,264.00	2,937,600
SONY FH	300	2,116.00	634,800
第一生命HLDS	2,000	1,767.50	3,535,000
東京海上HD	1,300	5,392.00	7,009,600
T&Dホールディングス	1,000	1,386.50	1,386,500
三井不動産	1,900	2,656.50	5,047,350
三菱地所	2,500	1,942.00	4,855,000
平和不動産	200	2,062.00	412,400
東京建物	400	1,318.00	527,200
住友不動産	800	4,160.00	3,328,000
レオパレス21	600	498.00	298,800
リログループ	200	2,956.00	591,200
イオンモール	200	1,871.00	374,200
東武鉄道	300	3,080.00	924,000
相鉄ホールディングス	200	3,305.00	661,000
東京急行	1,100	1,863.00	2,049,300
京浜急行	500	1,841.00	920,500
小田急電鉄	600	2,453.00	1,471,800
京王電鉄	200	6,190.00	1,238,000
京成電鉄	200	3,510.00	702,000

東日本旅客鉄道	600	10,280.00	6,168,000	
西日本旅客鉄道	300	8,045.00	2,413,500	
東海旅客鉄道	300	23,980.00	7,194,000	
西武ホールディングス	500	1,945.00	972,500	
鴻池運輸	200	1,676.00	335,200	
西日本鉄道	100	2,793.00	279,300	
近鉄グループHLDGS	300	4,780.00	1,434,000	
阪急阪神HLDGS	400	3,875.00	1,550,000	
南海電鉄	200	2,981.00	596,200	
京阪ホールディングス	100	4,515.00	451,500	
神戸電鉄	200	3,870.00	774,000	
名古屋鉄道	200	2,917.00	583,400	
山陽電鉄	200	2,085.00	417,000	
日本通運	100	6,770.00	677,000	
ヤマトホールディングス	600	2,852.50	1,711,500	
山 九	100	5,080.00	508,000	
センコーグループHLDGS	400	879.00	351,600	
ニッコンホールディングス	100	2,767.00	276,700	
福山通運	100	4,505.00	450,500	
セイノーホールディングス	300	1,535.00	460,500	
日立物流	100	3,225.00	322,500	
日本郵船	300	1,782.00	534,600	
商船三井	200	2,595.00	519,000	
飯野海運	700	396.00	277,200	
九州旅客鉄道	300	3,690.00	1,107,000	
SGホールディングス	300	2,992.00	897,600	
日本航空	600	4,084.00	2,450,400	
ANAホールディングス	600	4,058.00	2,434,800	
三菱倉庫	100	2,744.00	274,400	
三井倉庫HOLD	200	1,964.00	392,800	
住友倉庫	200	1,405.00	281,000	
上 組	200	2,427.00	485,400	
東京放送HD	200	1,936.00	387,200	
日本テレビHLDS	300	1,729.00	518,700	
日本電信電話	2,400	4,745.00	11,388,000	
KDDI	3,100	2,686.00	8,326,600	
ソフトバンク	2,800	1,353.00	3,788,400	
NTTドコモ	2,500	2,605.00	6,512,500	
GMOインターネット	200	1,530.00	306,000	
カドカワ	300	1,191.00	357,300	

ゼンリン	100	2,818.00	281,800
東京電力HD	2,900	680.00	1,972,000
中部電力	1,100	1,644.00	1,808,400
関西電力	1,500	1,599.50	2,399,250
中国電力	300	1,467.00	440,100
北陸電力	400	895.00	358,000
東北電力	800	1,436.00	1,148,800
四国電力	400	1,369.00	547,600
九州電力	700	1,307.00	914,900
北海道電力	500	774.00	387,000
沖縄電力	100	2,004.00	200,400
電源開発	300	2,749.00	824,700
東京瓦斯	600	2,930.00	1,758,000
大阪瓦斯	600	2,134.00	1,280,400
東邦瓦斯	200	4,655.00	931,000
西部瓦斯	100	2,515.00	251,500
静岡ガス	400	930.00	372,000
東宝	200	4,055.00	811,000
エイチ・アイ・エス	100	4,235.00	423,500
NTTデータ	1,100	1,323.00	1,455,300
共立メンテナンス	100	5,170.00	517,000
イチネンホールディングス	400	1,207.00	482,800
アインホールディングス	100	7,860.00	786,000
東京ドーム	400	945.00	378,000
DTS	100	4,425.00	442,500
スクウェア・エニックス・HD	200	3,625.00	725,000
カプコン	200	2,364.00	472,800
日本空港ビルデング	100	4,400.00	440,000
乃村工藝社	100	3,075.00	307,500
SCSK	100	4,810.00	481,000
セコム	400	9,098.00	3,639,200
メイテック	100	4,935.00	493,500
TKC	100	4,010.00	401,000
富士ソフト	100	4,575.00	457,500
NSD	100	2,408.00	240,800
コナミホールディングス	200	4,590.00	918,000
ベネッセホールディングス	100	2,917.00	291,700
イオンディライト	100	4,055.00	405,500
トラスコ中山	100	2,965.00	296,500
ヤマダ電機	1,200	542.00	650,400

アークランドサカモト	300	1,450.00	435,000	
ニトリホールディングス	200	14,755.00	2,951,000	
吉野家ホールディングス	300	1,758.00	527,400	
加藤産業	100	3,245.00	324,500	
イエローハット	100	2,667.00	266,700	
因幡電機産業	100	4,600.00	460,000	
パローホールディングス	100	2,668.00	266,800	
ミスミグループ本社	500	2,586.00	1,293,000	
ソフトバンクグループ	1,500	8,452.00	12,678,000	
スズケン	200	5,800.00	1,160,000	
サンドラッグ	100	3,565.00	356,500	
合計			806,256,520	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 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。

(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）並びに同規則第38条の3及び第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、当中間計算期間（2019年2月5日から2019年8月4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。

【中間財務諸表】

財形株投（年金・住宅財形30）

(1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	当中間計算期間末 2019年8月4日現在
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	25,835,111
親投資信託受益証券	557,177,203
流動資産合計	583,012,314
資産合計	583,012,314
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	234,835
未払委託者報酬	4,368,854
未払利息	112
その他未払費用	16,023
流動負債合計	4,619,824
負債合計	4,619,824
純資産の部	
元本等	
元本	¹ 580,993,256
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	² 2,600,766
（分配準備積立金）	58,722,284
元本等合計	578,392,490
純資産合計	578,392,490
負債純資産合計	583,012,314

(2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2019年2月5日 至 2019年8月4日
営業収益	
有価証券売買等損益	2,363,777
営業収益合計	2,363,777
営業費用	
支払利息	7,876
受託者報酬	234,835
委託者報酬	4,368,854
その他費用	17,848
営業費用合計	4,629,413
営業損失()	6,993,190
経常損失()	6,993,190
中間純損失()	6,993,190
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	30,541
期首剰余金又は期首欠損金()	4,513,054
剰余金増加額又は欠損金減少額	136,320
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	136,320
剰余金減少額又は欠損金増加額	287,491
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	287,491
中間剰余金又は中間欠損金()	2,600,766

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2019年2月5日 至 2019年8月4日
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、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 2019年8月4日現在
1. 1 期首元本額	593,434,746円
期中追加設定元本額	25,258,496円
期中一部解約元本額	37,699,986円
2. 中間計算期間末日における 受益権の総数	580,993,256口
3. 2 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は2,600,766円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2019年2月5日 至 2019年8月4日
	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

区 分	当中間計算期間末 2019年8月4日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品は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ん。

2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(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。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 2019年8月4日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 2019年8月4日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9955円 (9,955円)

（参考）

当ファンドは、「財形公社債マザーファンド」受益証券及び「財形株式マザーファンド」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あります。

なお、当ファンドの中間計算期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「財形公社債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年8月4日現在 金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	53,305,356
国債証券	606,041,130

地方債証券		536,864,585
未収利息		1,895,754
前払費用		14,958
流動資産合計		1,198,121,783
資産合計		1,198,121,783
負債の部		
流動負債		
未払利息		232
その他未払費用		862
流動負債合計		1,094
負債合計		1,094
純資産の部		
元本等		
元本	1	896,559,562
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		301,561,127
元本等合計		1,198,120,689
純資産合計		1,198,120,689
負債純資産合計		1,198,121,783

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2019年2月5日 至 2019年8月4日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び地方債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年8月4日現在
1. 1 期首	2019年2月5日
期首元本額	934,780,675円
期中追加設定元本額	- 円
期中一部解約元本額	38,221,113円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
財形株投（一般財形50）	342,360,546円
財形株投（一般財形30）	260,959,356円
財形株投（年金・住宅財形30）	293,239,660円
計	896,559,562円
2. 期末日における受益権の総数	896,559,562口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年8月4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. 金融商品の時価の算定方法	(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)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

2019年8月4日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	2019年8月4日現在
1口当たり純資産額	1.3364円
（1万口当たり純資産額）	（13,364円）

「財形株式マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	2019年8月4日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		12,417,540
株式		748,397,970
未収配当金		1,113,509
差入委託証拠金		360,000
流動資産合計		762,289,019
資産合計		762,289,019
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		221,064
前受金		83,800
未払利息		54
その他未払費用		210
流動負債合計		305,128
負債合計		305,128
純資産の部		
元本等		
元本	1	524,844,971
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		237,138,920
元本等合計		761,983,891
純資産合計		761,983,891
負債純資産合計		762,289,019

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 2019年2月5日 至 2019年8月4日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、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、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な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. デリバティブ取引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。</p> <p>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又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</p> <p>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>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年8月4日現在
1. 1 期首	2019年2月5日
期首元本額	556,143,696円
期中追加設定元本額	261,439円
期中一部解約元本額	31,560,164円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
財形株投（一般財形50）	309,710,415円
財形株投（一般財形30）	101,261,401円
財形株投（年金・住宅財形30）	113,873,155円
計	524,844,971円
2. 期末日における受益権の総数	524,844,971口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年8月4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. 金融商品の時価の算定方法	(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 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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）

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

種 類	2019年8月4日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	12,432,200	-	12,212,000	220,200
合計	12,432,200	-	12,212,000	220,200

（注） 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として期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又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期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おります。

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。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報）

	2019年8月4日現在
1口当たり純資産額	1.4518円
（1万口当たり純資産額）	（14,518円）

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2019年8月30日

資産総額	578,861,736円
負債総額	627,372円
純資産総額（ - ）	578,234,364円
発行済数量	582,868,279口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.9920円

(参考) 財形公社債マザーファンド

純資産額計算書

2019年8月30日

資産総額	1,200,600,148円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	1,200,600,148円
発行済数量	896,559,562口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3391円

(参考) 財形株式マザーファンド

純資産額計算書

2019年8月30日

資産総額	753,193,359円
負債総額	1,248,499円
純資産総額（ - ）	751,944,860円
発行済数量	524,844,971口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.4327円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行
受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(5) 受益権の譲渡
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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、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。）に社振法の規定にしたがい、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なわれるよう通知するものとします。

上記の振替について、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。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件
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。

(7) 受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、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。

(8) 償還金
償還金は、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（償還日以前において一部解約が行な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）に支払います。

(9) 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したがって取扱われます。

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2019年8月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後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ときまでです。

取締役会は、4名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

また、取締役、役付執行役員等から構成される経営会議は、経営全般にかかる基本的事項を審議し、決定します。経営会議は、分科会を設置し、専門的な事項についてはその権限を委ねることができます。

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。

ロ. 投資環境検討会

運用最高責任者であるCIO（Chief Investment Officer）が議長となり、原則として月1回投資環境検討会を開催し、投資環境について検討します。

ハ. 運用会議

CIOが議長となり、原則として月1回運用会議を開催し、基本的な運用方針を決定します。

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

ファンドマネージャーは、基本計画書に定められた各ファンドの諸方針と運用会議で決定された基本的な運用方針にしたがって運用計画書を作成します。運用部長は、ファンドマネージャーから提示を受けた運用計画書について、基本計画書および運用会議の決定事項との整合性等を確認し、承認します。

ホ. ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

・ファンド評価会議

運用実績・運用リスクの状況について、分析・検討を行ない、運用部にフィードバックします。

・運用審査会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用実績の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・リスクマネジメント会議

経営会議の分科会として、ファンドの運用リスクの状況・運用リスク管理等の状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

・執行役員会議

経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

2 【事業の内容及び営業の概況】

委託会社は、「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として、証券投資信託の設定を行なうとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行なっています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務等の関連する業務を行なっています。

2019年8月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	70	131,148
追加型株式投資信託	709	15,110,762
株式投資信託 合計	779	15,241,910
単位型公社債投資信託	29	97,726
追加型公社債投資信託	14	1,358,841
公社債投資信託 合計	43	1,456,567
総合計	822	16,698,477

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条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当事業年度(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,709	28,489
有価証券	0	554
前払費用	201	214
未収委託者報酬	12,368	11,468
未収収益	82	98
その他	47	56
流動資産計	41,410	40,882
固定資産		
有形固定資産	1	206
建物	12	10
器具備品	200	195
無形固定資産	2,614	2,821
ソフトウェア	2,456	2,804
ソフトウェア仮勘定	158	17
投資その他の資産	15,066	12,799
投資有価証券	8,600	8,493
関係会社株式	5,129	1,836
出資金	183	183
長期差入保証金	1,072	1,070
繰延税金資産	1,078	1,183
その他	34	31
固定資産計	18,927	15,827
資産合計	60,337	56,709

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	65	75
未払金	9,747	8,548
未払収益分配金	8	15
未払償還金	59	40
未払手数料	5,202	4,610
その他未払金	2 4,476	2 3,882
未払費用	4,148	3,735
未払法人税等	850	726
未払消費税等	583	255
賞与引当金	1,012	725
その他	335	2
流動負債計	16,744	14,070
固定負債		
退職給付引当金	2,350	2,389
役員退職慰労引当金	125	103
その他	5	2
固定負債計	2,481	2,496
負債合計	19,225	16,567
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,510	76,052
その他営業収益	733	673
営業収益計	83,244	76,725
営業費用		
支払手数料	40,392	35,789
広告宣伝費	673	694
調査費	9,816	9,066
調査費	955	1,057
委託調査費	8,860	8,009
委託計算費	839	1,351
営業雑経費	1,579	1,557
通信費	249	228
印刷費	500	513
協会費	53	55
諸会費	13	13
その他営業雑経費	762	746
営業費用計	53,300	48,459
一般管理費		
給料	5,840	5,755
役員報酬	377	373
給料・手当	3,973	4,145
賞与	477	510
賞与引当金繰入額	1,012	725
福利厚生費	788	796
交際費	55	64
旅費交通費	195	178
租税公課	501	472
不動産賃借料	1,281	1,291
退職給付費用	316	374

役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31 日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	210	215
有価証券償還益	17	133
その他	130	172
営業外収益計	359	521
営業外費用		
投資有価証券売却損	0	40
有価証券償還損	3	32
その他	25	60
営業外費用計	29	132
経常利益	18,741	16,961
特別損失		
関係会社整理損失	333	29
特別損失計	333	29
税引前当期純利益	18,407	16,931
法人税、住民税及び事業税	5,843	5,076
法人税等調整額	106	15
法人税等合計	5,737	5,060
当期純利益	12,670	11,870

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本合計	
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金 合計		
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金			繰越利益 剰余金

当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	12,712	13,086	39,756
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895

	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	264	264	39,540
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	41,112

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		

当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	798	798	798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	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	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

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) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) 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)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。なお、自社利用のソフトウェアについては社内における利用可能期間(5年間)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

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度毎に各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用しており、子会社株式等に対する投資に係る将来加算一時差異に基づく繰延税金負債を過年度に遡及して取り崩した結果、貸借対照表の繰延税金負債が480百万円減少し、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の遡及適用後の前事業年度期首残高が480百万円増加しております。

（未適用の会計基準等）

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

（1）概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

（2）適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

（3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）

（『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用）

「『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）等を当事業年度の期首から適用しており、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しております。

（損益計算書）

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取配当金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めておりました「有価証券償還損」は、営業外費用の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万円として組替えております。

（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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	29百万円	31百万円

器具備品

235百万円

264百万円

2 関係会社項目

関係会社に対する資産及び負債には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
未払金	4,406百万円	3,788百万円

3 保証債務

前事業年度(2018年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(2019年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自2017年4月1日至2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
2017年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 3月31日	2017年 6月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2018年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金

1株当たり配当額	4,857円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月26日

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2．配当に関する事項

（1）配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 3月31日	2018年 6月26日

（2）基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2019年6月21日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	11,868百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,550円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月24日

（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・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式

は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されておりま。

未払手数料は証券投資信託の販売に係る代行手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが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

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに為替変動リスク管理の検討を行っております。

() 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

信用リスクの管理

発行体の信用リスクは財務リスク管理規程に従い、定期的に財務状況等を把握しリスクマネジメント会議において報告を行っております。

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、次のとおりであります。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、次表には含めておりません(注2)参照のこと)。

前事業年度(2018年3月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金		28,709	28,709	-
(2) 未収委託者報酬		12,368	12,368	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券		7,631	7,631	-
資産計		48,709	48,709	-
(1) 未払手数料		(5,202)	(5,202)	-
(2) その他未払金		(4,476)	(4,476)	-
(3) 未払費用(*2)		(3,286)	(3,286)	-
負債計		(12,965)	(12,965)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

	貸借対照表	計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金		28,489	28,489	-

(2) 未収委託者報酬	11,468	11,468	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	8,380	8,380	-
資産計	48,338	48,338	-
(1) 未払手数料	(4,610)	(4,610)	-
(2) その他未払金	(3,882)	(3,882)	-
(3) 未払費用(*2)	(2,805)	(2,805)	-
負債計	(11,298)	(11,298)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項(有価証券関係)をご参照下さい。

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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：百万円)

区分	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	1,836
(3) 長期差入保証金	1,072	1,070

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、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ため、時価開示の対象としておりません。

(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(2018年3月31日)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-

有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

当事業年度(2019年3月31日)

(単位:百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

(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(2018年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 5,129百万円)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(2019年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,836百万円)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(2018年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	134	55	79
(2) その他 証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)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、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(2019年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1)株式	87	55	32
(2)その他 証券投資信託	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,301	3,560	258
小計	3,301	3,560	258
合計	8,380	8,328	52

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)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、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1)株式	-	-	-
(2)その他 証券投資信託	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1)株式	389	86	-
(2)その他 証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

(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、非積立型の確定給付制度（退職一時金制度であります）及び確定拠出制度を採用しております。

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

	前事業年度	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,318百万円	2,350百万円
勤務費用	159	158
退職給付の支払額	166	171
その他	38	52
退職給付債務の期末残高	2,350	2,389

(2) 退職給付債務及び年金資産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

	前事業年度	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,350百万円	2,389百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389
退職給付引当金	2,350	2,389
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	159百万円	158百万円
その他	24	41
確定給付制度に係る退職給付費用	184	199

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171百万円、当事業年度174百万円であります。

（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内訳

（単位：百万円）

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		731
	719	
賞与引当金	244	182
システム関連費用	16	170
未払事業税	162	141
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	68	32
その他	297	240
繰延税金資産小計	1,602	1,592
評価性引当額	200	164
繰延税金資産合計	1,402	1,428
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	159	159
その他有価証券評価差額金	164	85
繰延税金負債合計	323	244
繰延税金資産の純額	1,078	1,183

(注)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の繰延税金負債の連結法人間取引（譲渡益）は480百万円減少しております。

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（2018年3月31日）

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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

当事業年度（2019年3月31日）

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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当社は、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

1. サービスごとの情報

単一のサービス区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

内国籍証券投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 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、記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

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。

[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]

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

[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。

[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)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	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 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,701	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	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(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証(注1)	1,719	-	-
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	有償減資(注2)	3,293	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行、及びMASへの全ての損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定めるとおりに決定しております。

(注2) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	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(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)(注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,048	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	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(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)(注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,063	長期差入保証金	1,055

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(注2)証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。委託者報酬の配分は、両者協議のうえ合理的に決定しております。

(注3)ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。

(注4)差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

2. 親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,760.66円	1株当たり純資産額	15,389.06円
1株当たり当期純利益	4,857.40円	1株当たり当期純利益	4,550.81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。

(注2)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の1株当たり純資産額は184円26銭増加しております。

(注3)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,670	11,870

普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525
-----------------	-----------	-----------

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又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。）。

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又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。）。

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。以下において同じ。）又は子法人等（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又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、若しくは取引の公正を害し、又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】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2020年4月1日付で、定款について次の変更を行なう予定です。

- ・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

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】

(1) 受託会社

名称 みずほ信託銀行株式会社

資本金の額 247,369百万円（2019年3月末日現在）

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。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位：百万円 (2019年3月 末日現在)	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	(注)

(注) 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。

2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行な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なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行いません。

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：資産管理サービス信託銀行株式会社

資本金の額：50,000百万円（2019年3月末日現在）

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へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
- ・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨
使用開始日を記載することがあります。

届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
次の事項を記載することがあります。
- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

次の事項を記載することがあります。

- ・大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更します。2020年4月1日以降、「大和投資信託」「大和証券投資信託委託株式会社」など当社名を表す記載につきましては、「大和アセットマネジメント株式会社」とお読み替え下さい。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

2019年5月24日

大和証券投資信託委託株式会社
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	小倉 加奈子	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治	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」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60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、大和証券投資信託委託株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

(注)2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成31年3月8日

大和証券投資信託委託株式会社
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 公認会計士 深井 康治 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

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」に掲げられている財形株投（年金・住宅財形30）の平成30年2月2日から平成31年2月4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、財形株投（年金・住宅財形30）の平成31年2月4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

大和証券投資信託委託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。

独立監査人の中間監査報告書

2019年9月6日

大和証券投資信託委託株式会社

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 公認会計士 深井 康治 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

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」に掲げられている財形株投（年金・住宅財形30）の2019年2月5日から2019年8月4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、財形株投（年金・住宅財形30）の2019年8月4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（2019年2月5日から2019年8月4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

大和証券投資信託委託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。
- (注) 2 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。