

- 【表紙】
- 【提出書類】 有価証券届出書
- 【提出先】 関東財務局長 殿
- 【提出日】 平成25年4月26日提出
- 【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社
- 【代表者の役職氏名】 取締役社長 白川 真
- 【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】 山部 努
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
- 【電話番号】 03-5555-3111
- 【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（一般財形30）
- 【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券の金
額】 継続申込期間（平成25年4月27日から平成26年4月25日まで）
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（一般財形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るほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。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 <http://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）

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】

平成25年4月27日から平成26年4月25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】

委託会社にお問い合わせ下さい。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 <http://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、いつでも自由に引出せ、使いみちも自由な天引貯蓄です。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．積立では、原則として3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、税金を差引いた後、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。

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、安定運用を行いません。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

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

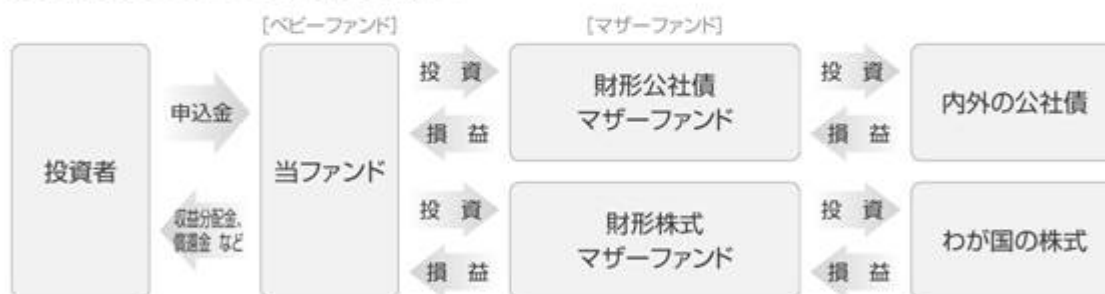
※東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所の第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、市場全体の株価の変動をとらえようとするものです。

- 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るものとします。



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。勤労者財産形成貯蓄（一般財形）を利用する場合に投資できます。

- いつでも自由に引出せ、使いみちも自由な天引貯蓄です。
- 積立投資専用のファンドです。積立では、原則として3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】

平成6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	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、次の業務を行ないません。 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
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	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、次の業務を行ないません。 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
運用指図	損益 信託金（ 3 ）	
2	受託会社	みずほ信託銀行株式会社 再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社
		信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないません。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。 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
		損益 投資
投資対象	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ないます。）	

（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（平成25年2月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

昭和34年12月12日 設立登記

昭和35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

昭和35年 4月 1日 営業開始

昭和60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。
 平成 7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。
 平成 7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。
 平成19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書
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。

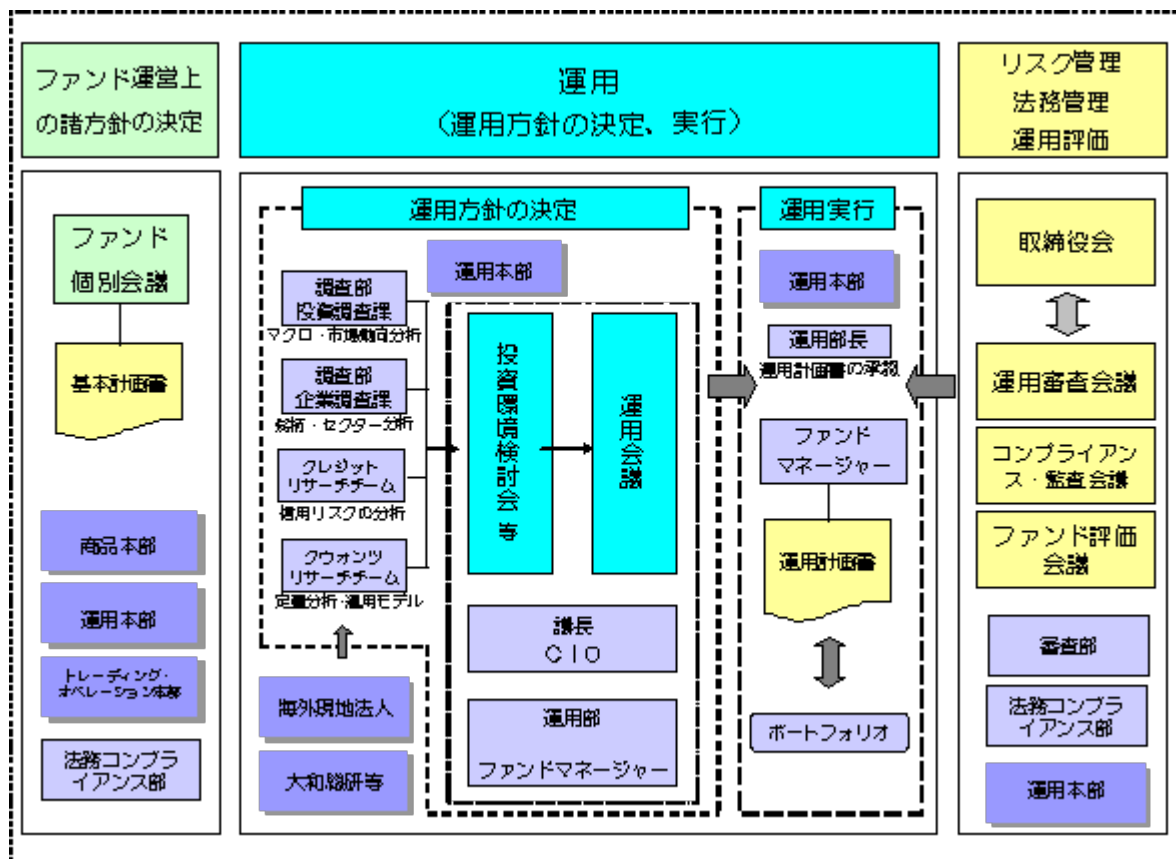
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

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C I O（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

C I O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．C I O（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．インベストメント・オフィサー（1～5名程度）

ＣＩＯを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．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。

ニ．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、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

ファンド評価会議は、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。また、運用審査会議は、経営会議の分科会として、ファンドの運用実績を把握し評価するとともに、取締役会から権限を委任され、ファンドの運用リスク管理の状況についての報告を受けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるコンプライアンス・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

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25～35名程度です。

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。

上記の運用体制は平成25年2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ます。

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ます。）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等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。

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。

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、))
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、)
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。

基準価額の主な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

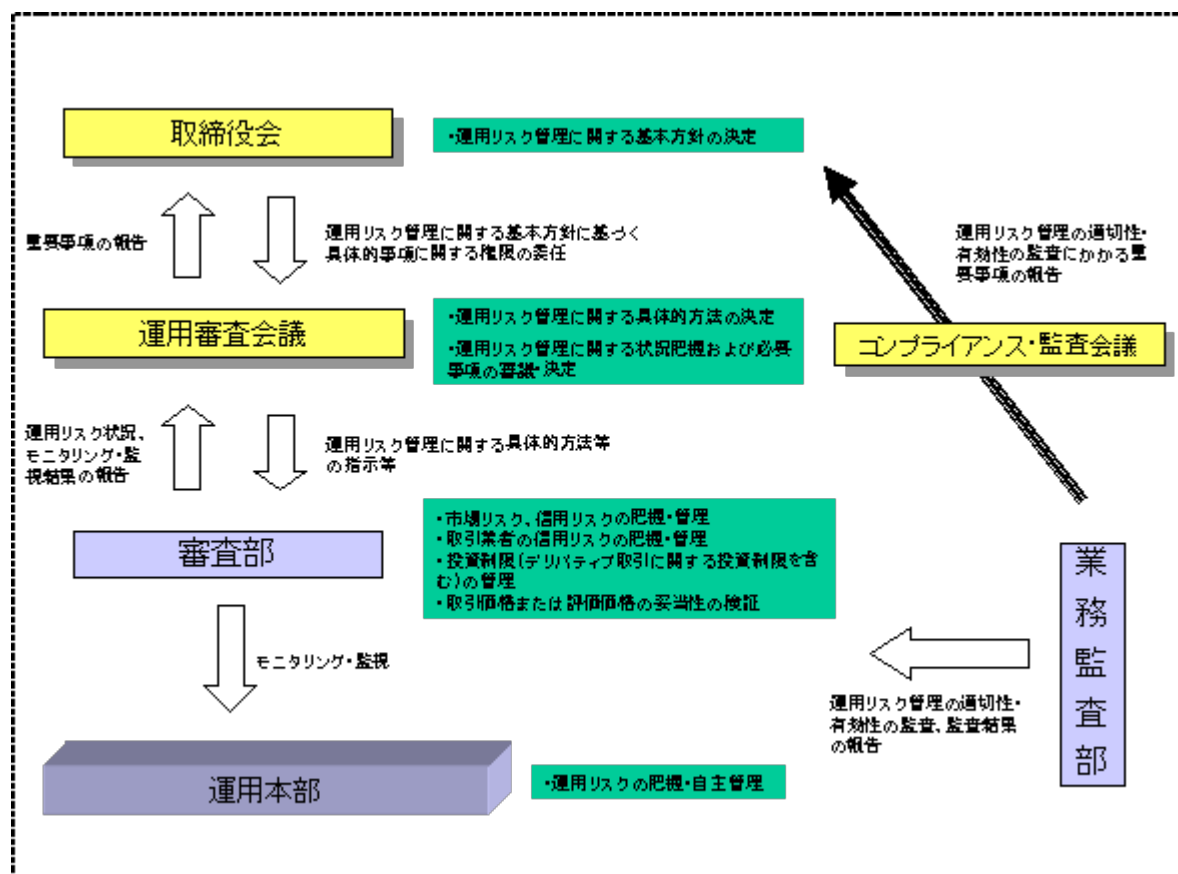
通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

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



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1.5435%（税抜1.47%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、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0.347655% （税抜0.3311%）	年率1.117095% （税抜1.0639%）	年率0.07875% （税抜0.075%）

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。

(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。

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、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、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成49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ます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

期間	税率
平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%および地方税3%）
平成26年1月1日から	20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）

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、上場株式等の譲渡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との損益通算も可能となります。

買取請求時の1万口当たりの手取額は、買取請求受付日の基準価額から、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差引いた金額となります（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。）。買取価額と取得価額との差額については、譲渡所得の取扱いとなります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

<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、個別元本方式は平成12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、平成12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。

（ ）上記は、平成25年2月末現在のもので、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】（平成25年2月28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	497,905,214	96.13
内 日本	497,905,214	96.13
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	20,035,417	3.87
純資産総額	517,940,631	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】（平成25年2月28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	270,090,484 345,667,421	1.2798	1.2859 347,309,353	67.06
2	財形株式マザーファンド	日本	親投資信託受 益証券	186,173,645 147,393,674	0.7916	0.8089 150,595,861	29.08

(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	96.13%
合計	96.13%

(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10計算期間末 (平成16年2月2日)	384,082,193	384,293,220	0.9100	0.9105
第11計算期間末 (平成17年2月1日)	396,492,378	396,707,085	0.9233	0.9238
第12計算期間末 (平成18年2月1日)	461,090,372	461,315,963	1.0220	1.0225
第13計算期間末 (平成19年2月1日)	484,932,752	485,169,672	1.0234	1.0239
第14計算期間末 (平成20年2月4日)	475,237,489	475,485,477	0.9582	0.9587
第15計算期間末 (平成21年2月2日)	434,155,484	434,155,484	0.8274	0.8274
第16計算期間末 (平成22年2月1日)	473,245,756	473,245,756	0.8638	0.8638
第17計算期間末 (平成23年2月1日)	489,873,772	489,873,772	0.8619	0.8619
第18計算期間末 (平成24年2月1日)	483,166,942	483,166,942	0.8163	0.8163
平成24年2月末日	495,634,072	-	0.8396	-
3月末日	493,056,800	-	0.8465	-
4月末日	484,544,089	-	0.8312	-
5月末日	469,940,399	-	0.8053	-
6月末日	485,701,343	-	0.8202	-
7月末日	480,283,386	-	0.8091	-
8月末日	477,917,986	-	0.8065	-
9月末日	477,295,491	-	0.8099	-
10月末日	474,460,694	-	0.8104	-
11月末日	481,458,322	-	0.8222	-
12月末日	502,058,477	-	0.8436	-
平成25年1月末日	511,640,793	-	0.8660	-
第19計算期間末 (平成25年2月4日)	513,470,101	513,470,101	0.8692	0.8692
2月末日	517,940,631	-	0.8766	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第10計算期間	0.0005
第11計算期間	0.0005
第12計算期間	0.0005
第13計算期間	0.0005
第14計算期間	0.0005

第15計算期間	0.0000
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

【収益率の推移】

	収益率(%)
第10計算期間	6.2
第11計算期間	1.5
第12計算期間	10.7
第13計算期間	0.2
第14計算期間	6.3
第15計算期間	13.7
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

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量（口）	解約数量（口）
第10計算期間	65,548,573	71,987,103
第11計算期間	61,042,564	53,682,672
第12計算期間	62,917,900	41,150,676
第13計算期間	71,261,490	48,603,202
第14計算期間	77,467,324	55,329,961
第15計算期間	86,505,921	57,754,094
第16計算期間	87,209,613	64,076,606
第17計算期間	82,396,571	61,922,109
第18計算期間	78,994,555	55,463,962
第19計算期間	70,429,594	71,567,584

(参考) 財形公社債マザーファンド

(1) 投資状況（平成25年2月28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	1,087,538,700	97.39
内 日本	1,087,538,700	97.39
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	29,167,656	2.61
純資産総額	1,116,706,356	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（平成25年2月28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	3 2 2 2年国債	日本	国債証券	140,000,000	100.06 140,085,400	100.09 140,130,200	0.100000 2014/11/15	12.55
2	3 0 1 10年国債	日本	国債証券	50,000,000	107.56 53,782,800	107.94 53,974,000	1.500000 2019/06/20	4.83
3	3 0 6 10年国債	日本	国債証券	50,000,000	106.89 53,446,800	107.43 53,719,500	1.400000 2020/03/20	4.81
4	2 9 6 10年国債	日本	国債証券	50,000,000	107.07 53,537,500	107.42 53,713,500	1.500000 2018/09/20	4.81
5	3 1 4 10年国債	日本	国債証券	50,000,000	103.94 51,974,500	105.04 52,522,500	1.100000 2021/03/20	4.70
6	3 1 8 10年国債	日本	国債証券	50,000,000	102.81 51,407,000	104.01 52,006,500	1.000000 2021/09/20	4.66
7	3 2 1 10年国債	日本	国債証券	50,000,000	102.39 51,197,500	103.69 51,849,000	1.000000 2022/03/20	4.64
8	3 2 5 10年国債	日本	国債証券	50,000,000	100.17 50,089,000	101.48 50,742,500	0.800000 2022/09/20	4.54
9	9 6 5年国債	日本	国債証券	50,000,000	101.30 50,652,500	101.35 50,676,000	0.500000 2016/03/20	4.54
10	9 7 5年国債	日本	国債証券	50,000,000	101.04 50,520,000	101.10 50,550,500	0.400000 2016/06/20	4.53
11	8 8 5年国債	日本	国債証券	50,000,000	100.91 50,459,000	100.92 50,464,500	0.500000 2015/03/20	4.52
12	8 4 5年国債	日本	国債証券	50,000,000	100.86 50,433,500	100.84 50,424,000	0.700000 2014/06/20	4.52
13	9 2 5年国債	日本	国債証券	50,000,000	100.61 50,307,000	100.64 50,324,000	0.300000 2015/09/20	4.51
14	7 9 5年国債	日本	国債証券	50,000,000	100.54 50,271,000	100.50 50,252,500	0.700000 2013/12/20	4.50
15	1 0 6 5年国債	日本	国債証券	50,000,000	100.22 50,114,500	100.40 50,203,500	0.200000 2017/09/20	4.50
16	3 1 1 10年国債	日本	国債証券	40,000,000	102.54 41,016,800	103.00 41,202,400	0.800000 2020/09/20	3.69
17	3 2 7 10年国債	日本	国債証券	40,000,000	100.05 40,022,700	101.28 40,515,200	0.800000 2022/12/20	3.63
18	8 5 5年国債	日本	国債証券	30,000,000	101.02 30,308,100	101.01 30,303,900	0.700000 2014/09/20	2.71
19	2 9 5 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	106.95 21,390,000	107.20 21,441,000	1.500000 2018/06/20	1.92
20	3 0 5 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	106.15 21,230,400	106.76 21,353,600	1.300000 2019/12/20	1.91

21	8 7 5 年国債	日本	国債証券	20,000,000	100.81 20,162,200	100.81 1,163,400	0.500000 2014/12/20	1.81
22	3 0 9 1 0 年国債	日本	国債証券	10,000,000	104.30 10,430,000	105.33 1,533,500	1.100000 2020/06/20	0.94
23	3 2 0 1 0 年国債	日本	国債証券	10,000,000	102.59 10,259,000	103.86 1,386,300	1.000000 2021/12/20	0.93
24	1 0 5 5 年国債	日本	国債証券	10,000,000	100.26 10,026,000	100.42 1,042,700	0.200000 2017/06/20	0.90
25	1 0 7 5 年国債	日本	国債証券	10,000,000	100.19 10,019,300	100.40 1,040,500	0.200000 2017/12/20	0.90
26	3 0 5 2 年国債	日本	国債証券	10,000,000	100.04 10,004,200	100.03 1,003,500	0.200000 2013/06/15	0.90

(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	97.39%
合計	97.39%

(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。

(参考) 財形株式マザーファンド

(1) 投資状況 (平成25年2月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	720,044,160	97.13
内 日本	720,044,160	97.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	21,245,048	2.87
純資産総額	741,289,208	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)	19,420,000	2.62
内 日本	19,420,000	2.62

(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（平成25年2月28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	6,700	4,595.00 30,786,500	4,765.00 31,925,500	4.31
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	39,800	529.49 21,073,969	513.00 20,417,400	2.75
3	本田技研	日本	株式	輸送用機器	4,400	3,550.00 15,620,000	3,455.00 15,202,000	2.05
4	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,000	3,853.75 15,415,029	3,710.00 14,840,000	2.00
5	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	67,500	193.18 13,039,943	204.00 13,770,000	1.86
6	キヤノン	日本	株式	電気機器	3,200	3,315.00 10,608,000	3,365.00 10,768,000	1.45
7	武田薬品	日本	株式	医薬品	2,000	4,675.00 9,350,000	4,795.00 9,590,000	1.29
8	三菱地所	日本	株式	不動産業	4,000	2,184.00 8,736,000	2,310.00 9,240,000	1.25
9	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	2,100	3,925.00 8,242,500	4,250.00 8,925,000	1.20
10	ソフトバンク	日本	株式	情報・通信業	2,500	3,455.00 8,637,500	3,435.00 8,587,500	1.16
11	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	2,600	2,975.00 7,735,000	2,925.00 7,605,000	1.03
12	三菱商事	日本	株式	卸売業	4,000	1,922.00 7,688,000	1,839.00 7,356,000	0.99
13	ファナック	日本	株式	電気機器	500	14,330.00 7,165,000	14,310.00 7,155,000	0.97
14	日立	日本	株式	電気機器	12,000	567.00 6,804,000	520.00 6,240,000	0.84
15	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	900	6,270.00 5,643,000	6,840.00 6,156,000	0.83
16	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	6,500	975.00 6,337,500	937.00 6,090,500	0.82
17	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	日本	株式	情報・通信業	42	137,100.00 5,758,200	143,400.00 6,022,800	0.81
18	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	1,200	4,690.00 5,628,000	5,010.00 6,012,000	0.81

19	三井物産	日本	株式	卸売業	4,300	1,389.00 5,972,700	1,374.00 5,908,200	0.80
20	小松製作所	日本	株式	機械	2,500	2,460.00 6,150,000	2,338.00 5,845,000	0.79
21	新日鐵住金	日本	株式	鉄鋼	23,000	274.00 6,302,000	251.00 5,773,000	0.78
22	信越化学	日本	株式	化学	1,000	5,510.00 5,510,000	5,700.00 5,700,000	0.77
23	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	2,100	2,814.00 5,909,400	2,706.00 5,682,600	0.77
24	野村ホールディングス	日本	株式	証券、商品先 物取引業	10,600	523.02 5,544,076	532.00 5,639,200	0.76
25	東京海上HD	日本	株式	保険業	2,000	2,779.68 5,559,379	2,618.00 5,236,000	0.71
26	デンソー	日本	株式	輸送用機器	1,300	3,580.00 4,654,000	3,890.00 5,057,000	0.68
27	KDDI	日本	株式	情報・通信 業	700	6,820.00 4,774,000	6,960.00 4,872,000	0.66
28	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	1,700	2,414.00 4,103,800	2,844.00 4,834,800	0.65
29	三井不動産	日本	株式	不動産業	2,000	2,093.00 4,186,000	2,358.00 4,716,000	0.64
30	三菱重工業	日本	株式	機械	9,000	502.00 4,518,000	514.00 4,626,000	0.62

(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	97.13%
合計	97.13%

(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	0.51%
建設業	2.46%
食料品	3.80%
繊維製品	0.73%
パルプ・紙	0.31%
化学	5.93%
医薬品	4.85%
石油・石炭製品	0.81%
ゴム製品	1.07%
ガラス・土石製品	1.02%
鉄鋼	1.61%
非鉄金属	1.05%
金属製品	0.62%
機械	4.98%

電気機器	10.79%
輸送用機器	11.44%
精密機器	1.23%
その他製品	1.39%
電気・ガス業	2.10%
陸運業	4.08%
海運業	0.38%
空運業	0.55%
倉庫・運輸関連業	0.16%
情報・通信業	5.67%
卸売業	4.83%
小売業	4.09%
銀行業	10.32%
証券、商品先物取引業	1.58%
保険業	2.29%
その他金融業	1.03%
不動産業	3.14%
サービス業	2.20%
合計	97.13%

(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	TOPIX先物 2013年3月	買建	2	19,140,000	19,420,000	2.62%

(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。

[次へ](#)

(参考情報)

2013年2月28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	8,766円
純資産総額	5.1億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	1.2%
3カ月間	6.6%
6カ月間	8.7%
1年間	4.4%
3年間	1.7%
5年間	-7.7%
設定来	-11.7%



※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8期 02年2月	第9期 03年2月	第10期 04年2月	第11期 05年2月	第12期 06年2月	第13期 07年2月	第14期 08年2月	第15期 09年2月	第16期 10年2月	第17期 11年2月	第18期 12年2月	第19期 13年2月
分配金	5円	5円	5円	5円	5円	5円	5円	0円	0円	0円	0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	26	65.3%	直接利回り(%)	輸送用機器	3.3%	トヨタ自動車	輸送用機器	1.3%
国内株式・先物	609	29.0%	最終利回り(%)	電気機器	3.1%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	0.8%
			修正デュレーション	銀行業	3.0%	TOPIX先物 2503月	-	0.8%
コール・ローン、その他		6.5%	残存年数	化学	1.7%	本田技研	輸送用機器	0.6%
合計	635	-	債券格付別構成	情報・通信業	1.6%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	0.6%
			AAA	機械	1.4%	みずほフィナンシャルG	銀行業	0.5%
株式市場・上場別構成			AA	医薬品	1.4%	キャノン	電気機器	0.4%
一部(東証・大証・名証)		28.2%	A	卸売業	1.4%	武田薬品	医薬品	0.4%
二部(東証・大証・名証)		-	BBB	小売業	1.2%	三菱地所	不動産業	0.4%
新興市場他		-	BB	その他	10.0%	日本電信電話	情報・通信業	0.4%
その他		-	合計	合計	28.2%	合計	合計	6.0%
合計		28.2%	合計	合計	100.0%	合計	合計	28.2%

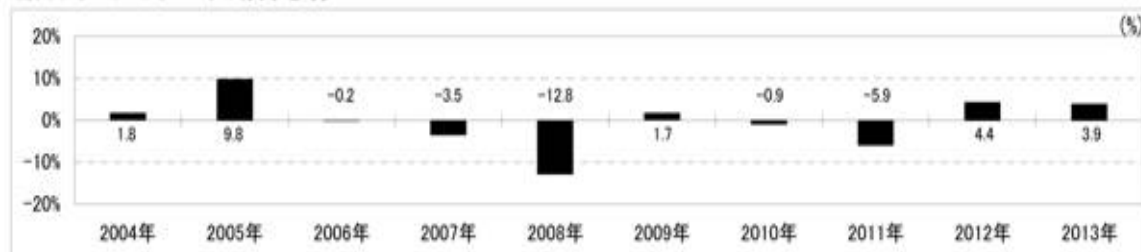
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※債券格付別構成について、日系発行体はR&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、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。

・2013年は2月28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せん。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せん。

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るほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。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 <http://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け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求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付けたものとして、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

受益者が買取り請求をするときは、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。

振替受益権の買取り価額は、買取りの申込みを受け付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、買取り価額を、販売会社に問合わせる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、受益者は買取り中止以前に行なった当日の買取り請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取り請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の買取り価額は、買取り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付けたものとして、上記に準じて計算された価額とします。

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るほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。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 <http://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、前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、公告を行ないません。
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すべき旨を請求することができます。

運用報告書

委託会社は、計算期間の末日ごとに、期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、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。

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。
<http://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ます。

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに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19期計算期間（平成24年2月2日から平成25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】

財形株投（一般財形30）

財形株投（一般財形30）

(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第18期 平成24年2月1日現在	第19期 平成25年2月4日現在
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	28,397,365	22,854,254
親投資信託受益証券	458,490,575	491,007,755
未収入金	-	3,500,000
流動資産合計	486,887,940	517,362,009
資産合計	486,887,940	517,362,009
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	55,285
未払受託者報酬	189,175	195,049
未払委託者報酬	3,519,294	3,628,654
その他未払費用	12,529	12,920
流動負債合計	3,720,998	3,891,908
負債合計	3,720,998	3,891,908
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 591,867,553	¹ 590,729,563
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 108,700,611	² 77,259,462
（分配準備積立金）	17,882,937	15,844,507
元本等合計	483,166,942	513,470,101
純資産合計	483,166,942	513,470,101
負債純資産合計	486,887,940	517,362,009

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第18期 自 平成23年2月2日 至 平成24年2月1日	第19期 自 平成24年2月2日 至 平成25年2月4日
営業収益		
受取利息	17,839	15,647
有価証券売買等損益	18,718,647	39,017,180
営業収益合計	18,700,808	39,032,827
営業費用		
受託者報酬	379,517	384,036
委託者報酬	7,060,132	7,144,738
その他費用	25,129	25,438
営業費用合計	7,464,778	7,554,212
営業利益又は営業損失（ ）	26,165,586	31,478,615
経常利益又は経常損失（ ）	26,165,586	31,478,615
当期純利益又は当期純損失（ ）	26,165,586	31,478,615
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（ ）	1,749,656	648,831
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	78,463,188	108,700,611
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,742,371	13,127,587
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,742,371	13,127,587
剰余金減少額又は欠損金増加額	13,563,864	12,516,222
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,563,864	12,516,222
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	108,700,611	77,259,462

(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19期 自 平成24年2月2日 至 平成25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25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25年2月4日としております。このため、当計算期間は369日となっております。

(追加情報)

第19期 自 平成24年2月2日 至 平成25年2月4日
第19期計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

区分	第18期 平成24年2月1日現在	第19期 平成25年2月4日現在
1. 1 期首元本額	568,336,960円	591,867,553円
期中追加設定元本額	78,994,555円	70,429,594円
期中一部解約元本額	55,463,962円	71,567,584円
2. 計算期間末日における受益権の総数	591,867,553口	590,729,563口
3. 2 元本の欠損	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108,700,611円であります。	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77,259,462円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	第18期 自 平成23年2月2日 至 平成24年2月1日	第19期 自 平成24年2月2日 至 平成25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(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(57,679,879円)及び分配準備積立金(17,882,937円)より分配対象額は75,562,816円(1万口当たり1,276.68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(12,624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(59,585,534円)及び分配準備積立金(15,831,883円)より分配対象額は75,430,041円(1万口当たり1,276.90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19期 自 平成24年2月2日 至 平成25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19期 平成25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 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18期 平成24年2月1日現在	第19期 平成25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	18,618,604	34,864,065
合計	18,618,604	34,864,065

（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18期 平成24年2月1日現在	第19期 平成25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19期 自 平成24年2月2日 至 平成25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なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第18期 平成24年2月1日現在	第19期 平成25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)	0.8163円 (8,163円)	0.8692円 (8,692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	265,406,643	339,667,421	
	財形株式マザーファンド	191,158,690	151,340,334	
親投資信託受益証券 合計			491,007,755	
合計			491,007,755	

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。

[次へ](#)

「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24年2月1日現在	平成25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	57,990,490	39,037,486
国債証券	961,395,500	1,050,399,620
未収利息	1,893,385	1,203,701
前払費用	68,712	769,934
流動資産合計	1,021,348,087	1,091,410,741
資産合計	1,021,348,087	1,091,410,741
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
元本	1 800,085,897	852,830,826
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	221,262,190	238,579,915
元本等合計	1,021,348,087	1,091,410,741
純資産合計	1,021,348,087	1,091,410,741
負債純資産合計	1,021,348,087	1,091,410,741

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24年2月2日 至 平成25年2月4日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。

（追加情報）

自 平成24年2月2日 至 平成25年2月4日
本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区分	平成24年2月1日現在	平成25年2月4日現在
1. 1 期首	平成23年2月2日	平成24年2月2日
期首元本額	830,725,356円	800,085,897円
期中追加設定元本額	34,560,537円	93,434,860円
期中一部解約元本額	65,199,996円	40,689,931円

期末元本額の内訳		
ファンド名		
財形株投（一般財形50）	300,832,960円	330,136,037円
財形株投（一般財形30）	249,772,894円	265,406,643円
財形株投（年金・住宅財形30）	249,480,043円	257,288,146円
計	800,085,897円	852,830,826円
2. 期末日における受益権の総数	800,085,897口	852,830,826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24年2月2日 至 平成25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25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 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24年2月1日現在	平成25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	2,767,300	1,852,060
合計	2,767,300	1,852,060

（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23年2月2日から平成24年2月1日まで、及び平成24年2月2日から平成25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24年2月1日現在	平成25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24年2月1日現在	平成25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）	1.2765円 (12,765円)	1.2798円 (12,798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	3 0 5 2年国債	10,000,000	10,004,200	
	3 2 2 2年国債	140,000,000	140,085,400	
	3 2 3 2年国債	70,000,000	70,044,800	
	7 9 5年国債	50,000,000	50,271,000	
	8 4 5年国債	50,000,000	50,433,500	
	8 5 5年国債	30,000,000	30,308,100	
	8 7 5年国債	20,000,000	20,162,200	
	8 8 5年国債	50,000,000	50,459,000	
	9 2 5年国債	50,000,000	50,307,000	
	9 6 5年国債	50,000,000	50,652,500	
	9 7 5年国債	50,000,000	50,520,000	
	1 0 5 5年国債	10,000,000	10,026,000	
	1 0 6 5年国債	50,000,000	50,114,500	
	1 0 7 5年国債	10,000,000	10,019,300	
	2 9 5 10年国債	50,000,000	53,479,500	
	2 9 6 10年国債	50,000,000	53,537,500	
	3 0 1 10年国債	10,000,000	10,729,600	
	3 0 6 10年国債	10,000,000	10,651,200	
	3 0 9 10年国債	10,000,000	10,430,000	
	3 1 4 10年国債	50,000,000	51,974,500	
	3 1 8 10年国債	50,000,000	51,407,000	
	3 2 0 10年国債	10,000,000	10,259,000	
	3 2 1 10年国債	50,000,000	51,197,500	
	3 2 5 10年国債	50,000,000	50,089,000	
	3 2 7 10年国債	10,000,000	9,995,400	
	3 7 30年国債	26,000,000	25,492,480	
1 4 1 20年国債	18,000,000	17,749,440		
国債証券 合計			1,050,399,620	
合計			1,050,399,620	

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。

[次へ](#)

「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24年2月1日現在	平成25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	25,788,933	29,243,923
株式	656,855,240	732,744,780
派生商品評価勘定	356,617	1,002,386
未収入金	1,404,001	-
未収配当金	705,150	798,900
差入委託証拠金	585,000	450,000
流動資産合計	685,694,941	764,239,989
資産合計	685,694,941	764,239,989
負債の部		
流動負債		
前受金	351,000	710,000
未払金	4,108,308	-
未払解約金	-	10,500,000
流動負債合計	4,459,308	11,210,000
負債合計	4,459,308	11,210,000
純資産の部		
元本等		
元本	1,108,434,242	951,214,596
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	427,198,609	198,184,607
元本等合計	681,235,633	753,029,989
純資産合計	681,235,633	753,029,989
負債純資産合計	685,694,941	764,239,989

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24年2月2日 至 平成25年2月4日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 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。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。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。

（追加情報）

自 平成24年2月2日
至 平成25年2月4日

本報告書における開示対象ファンドの当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成24年2月1日現在	平成25年2月4日現在
1. 1 期首	平成23年2月2日	平成24年2月2日
期首元本額	995,899,988円	1,108,434,242円
期中追加設定元本額	170,437,917円	83,402,148円
期中一部解約元本額	57,903,663円	240,621,794円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
財形株投（一般財形50）	657,457,836円	573,377,247円
財形株投（一般財形30）	227,229,867円	191,158,690円
財形株投（年金・住宅財形30）	223,746,539円	186,678,659円
計	1,108,434,242円	951,214,596円
2. 期末日における受益権の総数	1,108,434,242口	951,214,596口
3. 2 元本の欠損	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427,198,609円であります。	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198,184,607円であります。

（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24年2月2日 至 平成25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25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 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24年2月1日現在	平成25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	109,240,170	153,302,971
合計	109,240,170	153,302,971

(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23年2月2日から平成24年2月1日まで、及び平成24年2月2日から平成25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24年2月1日現在				平成25年2月4日現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	22,344,000	-	22,710,000	366,000	18,130,000	-	19,140,000	1,010,000
合計	22,344,000	-	22,710,000	366,000	18,130,000	-	19,140,000	1,010,000

(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24年2月1日現在	平成25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)	0.6146円 (6,146円)	0.7917円 (7,917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	1,500	184	276,000	
マルハニチロホールディングス	3,000	159	477,000	
ホクト	300	1,721	516,300	
ショーボンドHD	100	3,295	329,500	
ミライト・ホールディングス	400	773	309,200	
国際石油開発帝石	7	520,000	3,640,000	
石油資源開発	100	3,330	333,000	
コムシスホールディングス	500	1,130	565,000	
大成建設	4,000	269	1,076,000	
大林組	2,000	466	932,000	
清水建設	2,000	298	596,000	
長谷工コーポレーション	5,500	86	473,000	
鹿島建設	3,000	270	810,000	
前田建設	1,000	356	356,000	
東鉄工業	300	1,300	390,000	
戸田建設	1,000	245	245,000	
大東建託	200	8,780	1,756,000	
五洋建設	1,500	229	343,500	
住友林業	700	914	639,800	
日本基礎技術	700	324	226,800	
大和ハウス	2,000	1,686	3,372,000	
積水ハウス	2,000	999	1,998,000	
ユアテック	1,000	306	306,000	
きんでん	1,000	612	612,000	
住友電設	300	1,087	326,100	
協和エクシオ	400	955	382,000	
日揮	1,000	2,506	2,506,000	
日清製粉G本社	500	1,096	548,000	
アコーディア・ゴルフ	4	87,100	348,400	
パソナグループ	4	47,100	188,400	
山崎製パン	1,000	1,046	1,046,000	
ヤクルト	400	3,525	1,410,000	
明治ホールディングス	200	4,005	801,000	
雪印メグミルク	300	1,568	470,400	
日本ハム	1,000	1,311	1,311,000	
米久	500	947	473,500	
NECフィールドディング	400	1,110	444,000	
総合警備保障	400	1,152	460,800	
日本駐車場開発	54	6,000	324,000	
カカクコム	100	3,400	340,000	
エムスリー	2	152,900	305,800	
ディー・エヌ・エー	300	2,875	862,500	
博報堂DYHLDGS	100	6,290	629,000	
サッポロホールディングス	1,000	329	329,000	
アサヒグループホールディン	1,100	1,987	2,185,700	
麒麟HD	2,000	1,159	2,318,000	
宝ホールディングス	1,000	781	781,000	
コカ・コーラウエスト	400	1,455	582,000	
伊藤園	300	1,765	529,500	
不二製油	300	1,215	364,500	
ローソン	200	6,800	1,360,000	

カワチ薬品	200	1,932	386,400
エービーシー・マート	100	3,365	336,500
ポイント	80	3,220	257,600
サーラコーポレーション	500	497	248,500
双日	4,800	145	696,000
アルフレッサホールディングス	200	3,965	793,000
キッコーマン	1,000	1,381	1,381,000
味の素	2,000	1,193	2,386,000
キュービー	500	1,191	595,500
ハウス食品	400	1,376	550,400
カゴメ	300	1,706	511,800
ニチレイ	1,000	447	447,000
日清食品HD	200	3,445	689,000
永谷園	1,000	885	885,000
日本たばこ産業	2,600	2,975	7,735,000
ヒューリック	700	615	430,500
DCMホールディングス	600	623	373,800
J. フロント リテイリング	1,000	518	518,000
マツモトキヨシHLDGS	200	2,171	434,200
ココカラファイン	100	2,977	297,700
三越伊勢丹HD	1,100	903	993,300
東洋紡	3,000	196	588,000
ユニチカ	6,000	55	330,000
日清紡ホールディングス	1,000	711	711,000
日東紡績	1,000	372	372,000
トヨタ紡織	300	1,190	357,000
野村不動産HLDGS	300	1,644	493,200
シップヘルスケアHD	100	2,672	267,200
セブン&アイ・HLDGS	2,100	2,814	5,909,400
ツルハホールディングス	100	7,600	760,000
帝人	3,000	202	606,000
東レ	4,000	533	2,132,000
クラレ	900	1,178	1,060,200
旭化成	3,000	539	1,617,000
SUMCO	400	948	379,200
ワコールホールディングス	1,000	937	937,000
TSIホールディングス	600	469	281,400
ITホールディングス	300	1,315	394,500
グリー	300	1,368	410,400
コーエーテクモHD	300	790	237,000
ネクソン	500	969	484,500
インターネットイニシアティブ	100	2,777	277,700
王子ホールディングス	3,000	294	882,000
三菱製紙	4,000	94	376,000
大王製紙	1,000	645	645,000
日本製紙G本社	400	1,331	532,400
昭和電工	4,000	140	560,000
住友化学	4,000	281	1,124,000
住友精化	1,000	336	336,000
日産化学	600	1,129	677,400
日本曹達	1,000	409	409,000
東ソー	2,000	236	472,000
セントラル硝子	1,000	276	276,000
東亜合成	1,000	376	376,000
電気化学	2,000	330	660,000

イビデン	400	1,264	505,600
信越化学	1,000	5,510	5,510,000
エア・ウォーター	1,000	1,152	1,152,000
大陽日酸	1,000	614	614,000
日本触媒	1,000	862	862,000
カネカ	1,000	487	487,000
協和発酵キリン	1,000	854	854,000
三菱瓦斯化学	1,000	601	601,000
三井化学	3,000	224	672,000
J S R	600	1,746	1,047,600
東京応化工業	200	1,782	356,400
三菱ケミカルH L D G S	3,500	428	1,498,000
ダイセル	1,000	640	640,000
住友ベークライト	1,000	358	358,000
積水化学	1,000	869	869,000
日本ゼオン	1,000	772	772,000
アイカ工業	400	1,522	608,800
宇部興産	3,000	192	576,000
積水樹脂	1,000	1,062	1,062,000
日立化成	300	1,264	379,200
積水化成品	1,000	228	228,000
日本化薬	1,000	1,028	1,028,000
野村総合研究所	300	2,069	620,700
電通	500	2,578	1,289,000
A D E K A	500	803	401,500
ミヨシ油脂	4,000	186	744,000
花王	1,400	2,599	3,638,600
武田薬品	2,000	4,675	9,350,000
アステラス製薬	1,200	4,690	5,628,000
大日本住友製薬	500	1,260	630,000
塩野義製薬	900	1,651	1,485,900
田辺三菱製薬	500	1,216	608,000
中外製薬	700	1,842	1,289,400
エーザイ	700	3,710	2,597,000
小野薬品	300	4,865	1,459,500
久光製薬	200	4,890	978,000
参天製薬	300	3,710	1,113,000
ツムラ	200	2,981	596,200
日医工	200	1,917	383,400
テルモ	400	4,060	1,624,000
みらかホールディングス	200	3,790	758,000
キッセイ薬品工業	300	1,808	542,400
生化学工業	400	998	399,200
第一三共	1,600	1,543	2,468,800
キョーリン製薬H D	200	1,853	370,600
大塚ホールディングス	1,000	2,918	2,918,000
大正製薬H D	100	6,220	622,000
大日本塗料	2,000	179	358,000
日本ペイント	1,000	838	838,000
関西ペイント	1,000	994	994,000
D I C	3,000	178	534,000
東洋インキS Cホールディン	1,000	395	395,000
オリエンタルランド	200	12,490	2,498,000
ダスキン	300	1,787	536,100
パーク24	400	1,626	650,400

フジ・メディア・HD	6	141,100	846,600
ラウンドワン	400	523	209,200
リゾートトラスト	200	1,988	397,600
オービック	30	19,670	590,100
ヤフー	37	37,300	1,380,100
トレンドマイクロ	200	2,721	544,200
日本オラクル	100	3,820	382,000
ユー・エス・エス	80	10,220	817,600
伊藤忠テクノソリューションズ	100	3,825	382,500
大塚商会	100	8,210	821,000
富士フイルムHLDGS	1,200	1,849	2,218,800
コニカミノルタHLDGS	1,500	745	1,117,500
資生堂	1,000	1,147	1,147,000
ライオン	1,000	442	442,000
ファンケル	400	1,035	414,000
コーセー	200	1,947	389,400
ドクターシーラボ	1	266,100	266,100
小林製薬	100	4,250	425,000
昭和シェル石油	600	527	316,200
コスモ石油	2,000	207	414,000
東燃ゼネラル石油	1,000	798	798,000
出光興産	100	7,950	795,000
JXホールディングス	6,200	537	3,329,400
横浜ゴム	1,000	718	718,000
東洋ゴム	1,000	324	324,000
ブリヂストン	1,700	2,414	4,103,800
住友ゴム	600	1,264	758,400
オカモト	1,000	312	312,000
三ツ星ベルト	1,000	495	495,000
バンドー化学	1,000	302	302,000
旭硝子	3,000	609	1,827,000
日本板硝子	3,000	100	300,000
日本電気硝子	1,000	453	453,000
住友大阪セメント	1,000	298	298,000
太平洋セメント	4,000	242	968,000
東海カーボン	1,000	377	377,000
TOTO	1,000	762	762,000
日本碍子	1,000	970	970,000
日本特殊陶業	1,000	1,112	1,112,000
新日鐵住金	24,000	274	6,576,000
神戸製鋼所	9,000	128	1,152,000
JFEホールディングス	1,500	2,272	3,408,000
日新製鋼HD	300	713	213,900
大和工業	200	2,708	541,600
丸一鋼管	200	2,045	409,000
大同特殊鋼	1,000	426	426,000
大平洋金属	1,000	491	491,000
日本製鋼所	1,000	516	516,000
三井金属	2,000	236	472,000
東邦亜鉛	1,000	418	418,000
三菱マテリアル	4,000	289	1,156,000
住友鉱山	1,000	1,528	1,528,000
DOWAホールディングス	1,000	644	644,000
古河機金	3,000	102	306,000
古河電工	2,000	190	380,000

住友電工	2,000	1,031	2,062,000
フジクラ	1,000	287	287,000
アサヒHD	200	1,782	356,400
東洋製罐	500	1,179	589,500
三和ホールディングス	1,000	440	440,000
三協立山	100	1,867	186,700
LIXILグループ	800	2,070	1,656,000
リンナイ	100	6,310	631,000
ユニプレス	200	2,156	431,200
日本発条	600	800	480,000
三浦工業	200	2,336	467,200
オークマ	1,000	703	703,000
アマダ	1,000	569	569,000
オーエスジー	400	1,214	485,600
森精機製作所	500	1,010	505,000
ディスコ	100	5,100	510,000
豊田自動織機	500	3,045	1,522,500
島精機製作所	200	2,019	403,800
やまびこ	200	1,568	313,600
ナブテスコ	300	1,818	545,400
SMC	200	15,790	3,158,000
小松製作所	2,600	2,460	6,396,000
住友重機械	2,000	385	770,000
日立建機	300	2,201	660,300
クボタ	3,000	1,054	3,162,000
東洋エンジニア	1,000	411	411,000
アイチ コーポレーション	600	494	296,400
荏原製作所	1,000	354	354,000
千代田化工建	1,000	1,124	1,124,000
ダイキン工業	700	3,615	2,530,500
栗田工業	400	1,785	714,000
ダイフク	500	605	302,500
フジテック	1,000	647	647,000
平和	200	1,587	317,400
SANKYO	200	3,640	728,000
アマノ	500	829	414,500
サンデン	1,000	417	417,000
ブラザー工業	800	984	787,200
グローリー	200	2,138	427,600
セガサミーホールディングス	600	1,578	946,800
ホシザキ電機	200	2,755	551,000
日本精工	1,000	685	685,000
NTN	2,000	288	576,000
ジェイテクト	700	992	694,400
不二越	1,000	383	383,000
ミネベア	1,000	308	308,000
THK	400	1,583	633,200
日立	12,000	567	6,804,000
東芝	11,000	403	4,433,000
三菱電機	5,000	773	3,865,000
富士電機	2,000	233	466,000
安川電機	1,000	849	849,000
明電舎	1,000	289	289,000
日立工機	400	799	319,600
マキタ	400	4,155	1,662,000

東芝テック	1,000	531	531,000
マブチモーター	100	4,160	416,000
日本電産	300	5,190	1,557,000
オムロン	600	2,145	1,287,000
日東工業	300	1,333	399,900
ジーエス・ユアサ コーポ	1,000	330	330,000
日本電気	7,000	269	1,883,000
富士通	5,000	400	2,000,000
沖電気	3,000	118	354,000
サンケン電気	1,000	364	364,000
セイコーエプソン	400	1,040	416,000
ワコム	2	294,600	589,200
パナソニック	6,100	692	4,221,200
ソニー	3,300	1,457	4,808,100
T D K	300	3,170	951,000
アルプス電気	600	593	355,800
パイオニア	900	249	224,100
ホシデン	500	520	260,000
ヒロセ電機	100	10,640	1,064,000
アルパイン	300	858	257,400
横河電機	700	1,034	723,800
アズビル	200	1,980	396,000
日本光電工業	200	3,065	613,000
堀場製作所	200	2,710	542,000
アドバンテスト	400	1,243	497,200
キーエンス	100	26,170	2,617,000
シスメックス	200	4,355	871,000
デンソー	1,300	3,580	4,654,000
スタンレー電気	500	1,531	765,500
ウシオ電機	500	1,000	500,000
カシオ	700	774	541,800
ファナック	600	14,330	8,598,000
ローム	300	3,190	957,000
浜松ホトニクス	300	3,490	1,047,000
新光電気工業	400	666	266,400
京セラ	400	8,100	3,240,000
太陽誘電	400	842	336,800
村田製作所	600	5,760	3,456,000
双葉電子工業	200	994	198,800
日東電工	500	5,490	2,745,000
東海理化電機	200	1,550	310,000
ニチコン	300	773	231,900
三井造船	3,000	160	480,000
日立造船	4,000	151	604,000
三菱重工業	9,000	502	4,518,000
川崎重工業	5,000	291	1,455,000
I H I	4,000	240	960,000
日産自動車	6,600	975	6,435,000
いすゞ自動車	3,000	598	1,794,000
トヨタ自動車	6,800	4,595	31,246,000
日野自動車	1,000	967	967,000
三菱自動車工業	13,000	125	1,625,000
日信工業	200	1,474	294,800
曙ブレーキ	600	488	292,800
タチエス	200	1,677	335,400

N O K	300	1,325	397,500
カヤバ工業	1,000	391	391,000
カルソニックカンセイ	1,000	400	400,000
ケーヒン	200	1,311	262,200
アイシン精機	500	3,220	1,610,000
マ ッ ダ	9,000	280	2,520,000
ダイハツ	1,000	1,895	1,895,000
本田技研	4,500	3,550	15,975,000
スズキ	1,100	2,401	2,641,100
富士重工業	2,000	1,353	2,706,000
ヤマハ発動機	900	1,159	1,043,100
エクセディ	100	1,957	195,700
豊田合成	200	2,143	428,600
エフ・シー・シー	200	2,061	412,200
シマノ	200	6,200	1,240,000
タカタ	200	1,923	384,600
テイ・エス テック	200	2,037	407,400
良品計画	100	5,130	513,000
三城ホールディングス	400	478	191,200
メディパルHD	700	1,139	797,300
ネットワンシステムズ	300	872	261,600
ドン・キホーテ	200	3,600	720,000
西松屋チェーン	400	771	308,400
ゼンショーホールディングス	400	1,061	424,400
ガリバーインターナショナル	70	3,810	266,700
ユナイテッドアローズ	100	2,323	232,300
島津製作所	1,000	629	629,000
スター精密	400	912	364,800
東京精密	200	1,663	332,600
ニコン	1,000	2,593	2,593,000
トプコン	300	841	252,300
オリンパス	700	2,136	1,495,200
大日本スクリーン	1,000	462	462,000
タムロン	100	2,595	259,500
HOYA	1,300	1,769	2,299,700
キヤノン	3,300	3,315	10,939,500
リ コ ー	2,000	1,008	2,016,000
シチズンホールディングス	900	520	468,000
パラマウントベッドHD	100	2,922	292,200
バンダイナムコHLDGS	600	1,298	778,800
パイロットコーポレーション	2	239,400	478,800
エイベックス・グループHD	200	2,680	536,000
トッパン・フォームズ	500	844	422,000
フジシールインターナショナル	200	2,063	412,600
大建工業	1,000	258	258,000
凸版印刷	2,000	572	1,144,000
大日本印刷	2,000	741	1,482,000
藤森工業	100	2,076	207,600
アシックス	600	1,296	777,600
ローランド	300	868	260,400
ヤマハ	500	968	484,000
リンテック	200	1,674	334,800
任 天 堂	300	8,850	2,655,000
タカラスタンダ - ド	1,000	684	684,000
コ ク ヨ	700	634	443,800

ニフコ	200	1,893	378,600
伊藤忠	4,200	1,064	4,468,800
丸紅	5,000	687	3,435,000
長瀬産業	500	1,010	505,000
豊田通商	600	2,249	1,349,400
兼松	3,000	146	438,000
美津濃	1,000	422	422,000
ファミリーマート	200	3,685	737,000
三井物産	4,500	1,389	6,250,500
東京エレクトロン	400	3,870	1,548,000
日立ハイテクノロジーズ	200	1,829	365,800
山善	600	682	409,200
住友商事	3,000	1,176	3,528,000
日本ユニシス	400	727	290,800
三菱商事	4,000	1,922	7,688,000
キャノンマーケティングJPN	300	1,267	380,100
阪和興業	1,000	354	354,000
ニプロ	500	680	340,000
岩谷産業	2,000	343	686,000
三愛石油	1,000	402	402,000
ユニ・チャーム	300	4,905	1,471,500
東邦ホールディングス	300	1,760	528,000
伊藤忠エネクス	600	505	303,000
サンリオ	200	3,555	711,000
リョーサン	200	1,790	358,000
日本瓦斯	100	1,139	113,900
島忠	200	1,942	388,400
チヨダ	100	2,089	208,900
リンガーハット	300	1,234	370,200
コメリ	100	2,466	246,600
青山商事	300	1,789	536,700
しまむら	100	9,140	914,000
高島屋	1,000	673	673,000
松屋	300	815	244,500
エイチ・ツー・オーリテイリング	1,000	740	740,000
ニッセンHD	800	329	263,200
パルコ	300	952	285,600
丸井グループ	900	753	677,700
クレディセゾン	500	1,924	962,000
イオン	1,800	1,033	1,859,400
ユニー	600	677	406,200
イズミ	300	1,938	581,400
ケーズホールディングス	200	2,373	474,600
新生銀行	5,000	178	890,000
あおぞら銀行	2,000	253	506,000
三菱UFJフィナンシャルG	39,700	530	21,041,000
りそなホールディングス	5,400	423	2,284,200
三井住友トラストHD	11,000	327	3,597,000
三井住友フィナンシャルG	3,900	3,860	15,054,000
第四銀行	2,000	336	672,000
西日本シティ銀行	3,000	253	759,000
千葉銀行	2,000	566	1,132,000
横浜銀行	3,000	433	1,299,000
常陽銀行	2,000	432	864,000
群馬銀行	1,000	442	442,000

武蔵野銀行	200	3,140	628,000
千葉興業銀行	500	732	366,000
東京都民銀行	300	931	279,300
七十七銀行	1,000	405	405,000
ふくおかフィナンシャルG	2,000	384	768,000
静岡銀行	1,000	867	867,000
十六銀行	2,000	322	644,000
スルガ銀行	1,000	1,245	1,245,000
八十二銀行	1,000	459	459,000
山梨中央銀行	1,000	378	378,000
滋賀銀行	1,000	518	518,000
南都銀行	1,000	402	402,000
百五銀行	1,000	399	399,000
京都銀行	1,000	744	744,000
ほくほくフィナンシャルG	5,000	151	755,000
広島銀行	2,000	388	776,000
中国銀行	1,000	1,328	1,328,000
伊予銀行	1,000	745	745,000
百十四銀行	1,000	371	371,000
琉球銀行	400	1,198	479,200
セブン銀行	3,000	227	681,000
みずほフィナンシャルG	67,100	193	12,950,300
紀陽ホールディングス	4,000	137	548,000
山口フィナンシャルG	1,000	906	906,000
興銀リース	200	2,445	489,000
東京センチュリーリース	200	2,109	421,800
SBIホールディングス	600	760	456,000
日本証券金融	500	648	324,000
北洋銀行	1,300	342	444,600
イオンクレジットサービス	200	2,022	404,400
アコム	140	2,307	322,980
ジャックス	1,000	455	455,000
オリコ	1,500	320	480,000
日立キャピタル	200	1,798	359,600
オリックス	280	10,440	2,923,200
三菱UFJリース	140	4,210	589,400
トモニホールディングス	1,000	399	399,000
大和証券G本社	5,000	561	2,805,000
野村ホールディングス	10,800	523	5,648,400
岡三証券グループ	1,000	621	621,000
丸三証券	500	673	336,500
東洋証券	1,000	253	253,000
東海東京HD	1,000	496	496,000
松井証券	500	851	425,500
NKSJホールディングス	1,200	1,946	2,335,200
カブドットコム証券	500	435	217,500
池田泉州HD	600	512	307,200
MS&AD	1,600	1,969	3,150,400
SONY FH	500	1,561	780,500
第一生命	29	136,600	3,961,400
東京海上HD	2,000	2,790	5,580,000
T&Dホールディングス	1,900	1,144	2,173,600
三井不動産	3,000	2,093	6,279,000
三菱地所	4,000	2,184	8,736,000
平和不動産	300	1,290	387,000

東京建物	1,000	423	423,000
ダイビル	400	910	364,000
東急不動産	1,000	643	643,000
住友不動産	1,000	2,791	2,791,000
大京	1,000	244	244,000
レオパレス21	700	348	243,600
住友不動産販売	80	4,590	367,200
東栄住宅	200	1,242	248,400
アーネストワン	200	1,475	295,000
イオンモール	300	2,188	656,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	5	91,400	457,000
東武鉄道	3,000	489	1,467,000
相鉄ホールディングス	1,000	307	307,000
東京急行	3,000	513	1,539,000
京浜急行	1,000	785	785,000
小田急電鉄	2,000	926	1,852,000
京王電鉄	2,000	686	1,372,000
京成電鉄	1,000	812	812,000
富士急行	1,000	544	544,000
東日本旅客鉄道	900	6,270	5,643,000
西日本旅客鉄道	400	3,680	1,472,000
東海旅客鉄道	400	8,020	3,208,000
近畿日本鉄道	5,000	383	1,915,000
阪急阪神HLDGS	3,000	504	1,512,000
南海電鉄	2,000	400	800,000
京阪電鉄	1,000	416	416,000
名古屋鉄道	2,000	255	510,000
日本通運	2,000	375	750,000
ヤマトホールディングス	900	1,504	1,353,600
山九	1,000	361	361,000
日本梱包運輸	400	1,307	522,800
セイノーホールディングス	1,000	628	628,000
神奈川中央交通	1,000	483	483,000
日本郵船	5,000	217	1,085,000
商船三井	3,000	308	924,000
川崎汽船	3,000	169	507,000
飯野海運	600	421	252,600
日本航空	500	3,815	1,907,500
全日本空輸	11,000	183	2,013,000
三菱倉庫	1,000	1,366	1,366,000
渋沢倉庫	1,000	315	315,000
上組	1,000	754	754,000
東京放送HD	400	1,063	425,200
日本テレビHLD S	600	1,268	760,800
テレビ朝日	200	1,446	289,200
スカパーJSATHD	8	43,350	346,800
日本電信電話	2,200	3,925	8,635,000
KDDI	800	6,820	5,456,000
光通信	100	4,140	414,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	42	137,100	5,758,200
東京電力	4,200	209	877,800
中部電力	1,600	1,131	1,809,600
関西電力	2,200	838	1,843,600
中国電力	800	1,178	942,400
北陸電力	500	1,029	514,500

東北電力	1,400	722	1,010,800
四国電力	500	1,101	550,500
九州電力	1,200	865	1,038,000
北海道電力	500	832	416,000
沖縄電力	100	3,020	302,000
電源開発	300	2,068	620,400
東京瓦斯	6,000	427	2,562,000
大阪瓦斯	4,000	337	1,348,000
東邦瓦斯	1,000	480	480,000
北海道瓦斯	1,000	241	241,000
西部瓦斯	1,000	218	218,000
静岡瓦斯	500	632	316,000
松竹	1,000	1,010	1,010,000
東宝	400	1,747	698,800
エイチ・アイ・エス	100	3,065	306,500
NTTデータ	3	270,200	810,600
アインファーマシーズ	100	4,920	492,000
東京ドーム	1,000	345	345,000
スクウェア・エニックス・HD	200	1,199	239,800
カプコン	200	1,549	309,800
日本空港ビルデング	300	989	296,700
トランス・コスモス	300	1,139	341,700
SCSK	200	1,740	348,000
セコム	500	4,550	2,275,000
メイテック	200	2,342	468,400
アサツー ディ・ケイ	200	2,438	487,600
富士ソフト	100	1,994	199,400
コナミ	300	1,912	573,600
ベネッセホールディングス	100	3,975	397,500
ニチイ学館	300	772	231,600
ダイセキ	200	1,347	269,400
ヤマダ電機	260	3,470	902,200
オートバックスセブン	100	3,840	384,000
ニトリホールディングス	100	7,000	700,000
因幡電機産業	200	2,926	585,200
プレナス	200	1,520	304,000
バロー	300	1,521	456,300
ミスミグループ本社	300	2,400	720,000
ファーストリテイリング	100	25,020	2,502,000
ソフトバンク	2,600	3,455	8,983,000
スズケン	300	2,834	850,200
サンドラッグ	200	3,465	693,000
合計			732,744,780

(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。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成25年2月28日

資産総額	518,463,607円
負債総額	522,976円
純資産総額（ - ）	517,940,631円
発行済数量	590,843,016口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.8766円

(参考) 財形公社債マザーファンド

純資産額計算書

平成25年2月28日

資産総額	1,116,706,356円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	1,116,706,356円
発行済数量	868,443,629口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.2859円

(参考) 財形株式マザーファンド

純資産額計算書

平成25年2月28日

資産総額	744,825,257円
負債総額	3,536,049円
純資産総額（ - ）	741,289,208円
発行済数量	916,382,636口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.8089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

平成25年2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、3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、運用審査会議およびコンプライアンス・監査会議

ファンド評価会議は、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。また、運用審査会議は、経営会議の分科会として、ファンドの運用実績を把握し評価するとともに、取締役会から権限を委任され、ファンドの運用リスク管理の状況についての報告を受けて、必要事項を審議・決定します。

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるコンプライアンス・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、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。

平成25年2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	4	88,475
追加型株式投資信託	424	7,972,175
株式投資信託 合計	428	8,060,650
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	2,584,701
公社債投資信託 合計	17	2,584,701
総合計	445	10,645,351

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。

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

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第53期事業年度（平成23年4月1日から平成24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。

また、第54期事業年度に係る中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30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。

3. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

(単位:千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	1,820,358	3,745,233
有価証券	18,987,155	19,655,070
前払金	579	314
前払費用	24,840	90,562
未収入金	6,925	11,931
未収委託者報酬	6,933,076	6,516,540
未収収益	41,963	55,102
貯蔵品	23,337	11,888
繰延税金資産	286,080	630,508
その他	501,484	190,450
流動資産計	28,625,803	30,907,602
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物（純額）	967,190	1,003,450
器具備品（純額）	332,407	513,162
建設仮勘定	634,782	484,571
	-	5,715
無形固定資産	2,414,530	2,870,849
ソフトウェア	1,364,617	2,173,517
ソフトウェア仮勘定	1,037,069	684,878
電話加入権	11,850	11,850
商標権	396	132

その他		596		471
投資その他の資産		18,825,476		16,375,520
投資有価証券		12,339,547		10,034,136
関係会社株式		5,141,069		5,141,069
出資金		142,215		136,315
従業員に対する長期貸付金		99,889		112,674
差入保証金		609,781		542,920
長期前払費用		7,607		8,478
投資不動産(純額)	1	490,114	1	409,876
貸倒引当金		4,750		9,950
固定資産計		22,207,196		20,249,820
資産合計		50,833,000		51,157,423

(単位:千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	46,454	55,551
未払金	6,501,119	7,194,946
未払収益分配金	27,599	17,954
未払償還金	119,838	88,334
未払手数料	3,725,807	3,386,380
その他未払金	2	2,627,872
未払費用	2,395,029	3,313,011
未払法人税等	895,379	963,539
未払消費税等	383,973	229,365
賞与引当金	263,000	307,000
本社移転関連費用引当金	-	346,425
資産除去債務	-	292,000
その他	-	87,535
流動負債計	10,484,955	12,789,375
固定負債		
退職給付引当金	1,410,635	1,670,344
役員退職慰労引当金	59,160	68,068
繰延税金負債	1,977,913	1,782,558
固定負債計	3,447,708	3,520,970
負債合計	13,932,663	16,310,345
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		

繰越利益剰余金	9,874,176	7,715,116
利益剰余金合計	10,248,473	8,089,414
株主資本合計	36,918,473	34,759,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	104,040	33,879
繰延ヘッジ損益	85,902	53,783
評価・換算差額等合計	18,137	87,663
純資産合計	36,900,336	34,847,077
負債・純資産合計	50,833,000	51,157,423

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	72,303,483	72,931,048
その他営業収益	345,390	401,212
営業収益計	72,648,873	73,332,260
営業費用		
支払手数料	41,437,322	41,050,089
広告宣伝費	967,991	709,853
公告費	1,256	699
受益証券発行費	3	74
調査費	6,192,360	7,993,144
調査費	831,159	878,635
委託調査費	5,361,200	7,114,509
委託計算費	718,414	733,156
営業雑経費	1,806,147	1,651,996
通信費	287,454	205,421
印刷費	674,758	472,511
協会費	47,465	52,117
諸会費	10,778	11,971
その他営業雑経費	785,691	909,973
営業費用計	51,123,496	52,139,015
一般管理費		
給料	4,192,794	4,452,711
役員報酬	157,200	209,630
給料・手当	3,545,655	3,646,155
賞与	226,939	289,926
賞与引当金繰入額	263,000	307,000
福利厚生費	619,459	728,342
交際費	68,476	71,356
寄付金	638	591
旅費交通費	266,082	215,939
租税公課	169,305	171,533
不動産賃借料	680,147	727,939
退職給付費用	334,864	422,030
役員退職慰労引当金繰入額	28,500	27,988
固定資産減価償却費	897,352	1,107,222
諸経費	1,170,318	1,077,041
一般管理費計	8,427,939	9,002,696
営業利益	13,097,437	12,190,548

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)		当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	573,514		74,753
有価証券利息		23,029		13,537
受取利息		2,673		2,771
時効成立分配金・償還金		149,120		42,189
投資有価証券売却益		38,591		117,695
有価証券償還益		3,185		68,106
その他		41,908		54,685
営業外収益計		832,022		373,739
営業外費用				
投資有価証券売却損		7,515		95,389
有価証券償還損		277		67,873
その他		180,501		67,829
営業外費用計		188,294		231,091
経常利益		13,741,165		12,333,196
特別利益				
貸倒引当金戻入額		614,232		-
特別利益計		614,232		-
特別損失				
固定資産除却損	2	1,067	2	4,871
減損損失	3	35,468	3	76,217
有価証券評価損		-		211,376
本社移転関連費用		-		346,425
その他		22,059		19,547
特別損失計		58,595		658,438
税引前当期純利益		14,296,802		11,674,757
法人税、住民税及び事業税		4,834,931		5,254,642
法人税等調整額		256,140		602,832
法人税等合計		5,091,072		4,651,809
当期純利益		9,205,730		7,022,948

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	15,174,272	15,174,272
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計		
当期首残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	374,297	374,297
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	374,297	374,297
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	2,800,000	-
当期変動額		
別途積立金の取崩	2,800,000	-
当期変動額合計	2,800,000	-
当期末残高	-	-
繰越利益剰余金		
当期首残高	9,085,103	9,874,176
当期変動額		
別途積立金の取崩	2,800,000	-
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	789,072	2,159,059
当期末残高	9,874,176	7,715,116
利益剰余金合計		
当期首残高	12,259,401	10,248,473
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008

当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	2,010,927	2,159,059
当期末残高	10,248,473	8,089,414

(単位:千円)

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
株主資本合計		
当期首残高	38,929,401	36,918,473
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
当期変動額合計	2,010,927	2,159,059
当期末残高	36,918,473	34,759,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	18,061	104,040
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	85,978	137,920
当期変動額合計	85,978	137,920
当期末残高	104,040	33,879
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	55,712	85,902
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	141,615	32,119
当期変動額合計	141,615	32,119
当期末残高	85,902	53,783
評価・換算差額等合計		
当期首残高	73,774	18,137
当期変動額		
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	55,636	105,800
当期変動額合計	55,636	105,800
当期末残高	18,137	87,663
純資産合計		
当期首残高	38,855,627	36,900,336
当期変動額		
剰余金の配当	11,216,657	9,182,008
当期純利益	9,205,730	7,022,948
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	55,636	105,800
当期変動額合計	1,955,290	2,053,258
当期末残高	36,900,336	34,847,077

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

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．デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法により計上しております。

3．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

（リース資産を除く）

定率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	6～47年
器具備品	3～20年

(2) 無形固定資産（リース資産を除く）

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）に基づいております。

(3) 長期前払費用

定額法によっております。

4．引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

債権の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。

(2) 賞与引当金

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。

(3) 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、能力及び実績等に依りて各事業年度ごと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。

（４）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。

（５）本社移転関連費用引当金

本社移転に伴い発生する損失に備えるため、発生が見込まれる固定資産除却損、移転費用について合理的な見積額を計上しております。

５．ヘッジ会計の方法

（１）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。

（２）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段・・・株価指数先物

ヘッジ対象・・・投資有価証券

（３）ヘッジ方針

価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。

（４）ヘッジ有効性評価の方法

原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。

６．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

（１）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処理によっております。

（２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

表示方法の変更

（損益計算書）

１．前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めていた「有価証券償還益」は重要性が増し

たため当事業年度より区分掲記することとしました。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、前事業年度の損益計算書において、「営業外収益」の「その他」に表示していた45,094千円は、「有価証券償還益」3,185千円、「その他」41,908千円として組替えております。

2. 前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「有価証券償還損」は重要性が増したため、当事業年度より区分掲記することとしました。また、前事業年度において区分掲記していた「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」、「貯蔵品廃棄損」及び「投資不動産管理費用」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「時効成立後支払分配金・償還金」に表示していた98,613千円、「貯蔵品廃棄損」に表示していた25,533千円、「投資不動産管理費用」に表示していた20,028千円、及び「その他」に表示していた36,603千円は、「有価証券償還損」277千円、「その他」180,501千円として組替えております。

3. 前事業年度において区分掲記していた「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」は、重要性が低いため当事業年度より「その他」に含めて表示しております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「特別損失」の「ゴルフ会員権評価損」に表示していた21,290千円は、「その他」として組替えております。

追加情報

(会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用)

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

注記事項

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
建物	854,118千円	986,089千円
器具備品	2,129,756千円	2,234,738千円
投資建物	700,991千円	712,587千円
投資器具備品	28,141千円	22,398千円

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 (平成23年3月31日現在)	当事業年度 (平成24年3月31日現在)
未払金	2,591,913千円	3,577,654千円

3 保証債務

前事業年度（平成23年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,384,110千円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,372,770千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益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 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
受取配当金	460,584千円	-

2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
器具備品	1,067千円	4,812千円
投資不動産	-	59千円
計	1,067千円	4,871千円

3 減損損失に関する注記

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

場所 千葉県浦安市
用途 賃貸等不動産（浦安寮）
種類 建物及び土地

当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグループングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失（35,468千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物26,868千円及び土地8,600千円です。

なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により

評価しております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

当事業年度において、当社は以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

場所 千葉県浦安市
用途 賃貸等不動産（浦安寮）
種類 建物及び土地

当社は、浦安寮を大和証券グループ全体の補完的な寮として位置付け、本社と浦安寮の2つのグループピ
ングとしております。

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の
兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失
（76,217千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物17,417千円及び土地58,800千円で
あります。

なお、当該資産グループの回収可能価額は正味売却価額により測定しており、不動産鑑定評価額により
評価しております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23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
平成22年6月25日 定時株主総会	普通株式	11,216	4,300	平成22年 3月31日	平成22年 6月28日

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

平成23年6月24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通り提
案しております。

剰余金の配当の総額 9,182百万円
配当の原資 利益剰余金
1株当たり配当額 3,520円
基準日 平成23年3月31日

効力発生日 平成23年6月27日

当事業年度（自平成23年4月1日至平成24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
平成23年6月24日 定時株主総会	普通株式	9,182	3,520	平成23年 3月31日	平成23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

平成24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通り提案しております。

剰余金の配当の総額 7,022百万円
 配当の原資 利益剰余金
 1株当たり配当額 2,692円
 基準日 平成24年3月31日
 効力発生日 平成24年6月26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。また、デリバティブ取引は、事業遂行上生じた市場リスクヘッジのために利用し、投機的な取引は行いません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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、投資信託、株式であります。投資信託は余資運用及び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

おります。

未払手数料は投資信託の販売に係る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。

デリバティブ取引は株式先物取引を行っております。当社ではこれをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5.ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

（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、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、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、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し価格変動リスクをヘッジしております。なお、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ会計の要件を満たさなくなりましたので当事業年度末をもってヘッジ会計の適用を中止し、中止時点までのヘッジ手段に係る損益は、ヘッジ対象に係る損益が認識されるまで繰り延べております。

（ ）デリバティブ取引

デリバティブ取引に関しては、ヘッジ手段に用いる場合にのみ限定しております。取引の執行・管理については財務リスク管理規程に従って行っており、取引の状況を財務会議において行っております。

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財務会議において報告を行っております。

（4）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「2.金融商品の時価等に関する事項」における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。

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（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	1,820,358	1,820,358	-
(2) 未収委託者報酬	6,933,076	6,933,076	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	30,154,565	30,154,565	-
資産計	38,908,001	38,908,001	-
(1) 未払手数料	3,725,807	3,725,807	-
(2) その他未払金	2,627,872	2,627,872	-
(3) 未払費用(*1)	1,951,710	1,951,710	-
負債計	8,305,391	8,305,391	-
デリバティブ取引(*2)	183,430	183,430	-

(*1) 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。

(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、()で示しております。

当事業年度(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	3,745,233	3,745,233	-
(2) 未収委託者報酬	6,516,540	6,516,540	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	28,525,516	28,525,516	-
資産計	38,787,291	38,787,291	-
(1) 未払手数料	3,386,380	3,386,380	-
(2) その他未払金	3,702,277	3,702,277	-
(3) 未払費用(*1)	2,764,494	2,764,494	-
負債計	9,853,152	9,853,152	-
デリバティブ取引(*2)	(87,535)	(87,535)	-

(*1) 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。

(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、()で示しております。

<注1>金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資 産

(1) 現金・預金、及び(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、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。

デリバティブ取引

注記事項（デリバティブ取引関係）をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
(1) その他有価証券 非上場株式	1,172,137	1,163,689
(2) 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	5,141,069	5,141,069
(3) 差入保証金	609,781	542,920

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（平成23年3月31日現在）

（単位：千円）

	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	1,820,358	-	-	-
未収委託者報酬	6,933,076	-	-	-
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	-	1,588,634	4,868,529	-
合計	8,753,434	1,588,634	4,868,529	-

当事業年度（平成24年3月31日現在）

（単位：千円）

	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	3,745,233	-	-	-
未収委託者報酬	6,516,540	-	-	-
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	836,311	2,069,432	4,320,954	-
合計	11,098,084	2,069,432	4,320,954	-

（有価証券関係）

1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成23年3月31日現在）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,141,069千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,141,069千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2．その他有価証券

前事業年度（平成23年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	4,822,299	4,383,992	438,306
小計	4,822,299	4,383,992	438,306
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの （1）株式 （2）その他 証券投資信託の受益証券	54,283 25,277,982	55,101 25,890,888	818 612,906
小計	25,332,266	25,945,990	613,724
合計	30,154,565	30,329,983	175,417

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 1,172,137千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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（平成24年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 （千円）	取得原価 （千円）	差額 （千円）
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの その他 証券投資信託の受益証券	6,864,572	6,497,516	367,056
小計	6,864,572	6,497,516	367,056
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの （1）株式	49,871	55,101	5,230

(2) その他 証券投資信託の受益証券	21,611,072	21,918,194	307,122
小計	21,660,944	21,973,296	312,352
合計	28,525,516	28,470,813	54,703

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,163,689千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、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 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他 証券投資信託の受益証券	21,607,835	38,591	7,515
合計	21,607,835	38,591	7,515

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他 証券投資信託の受益証券	16,215,351	117,695	95,389
合計	16,215,351	117,695	95,389

4. 減損処理を行った有価証券

当事業年度において、その他有価証券（その他）について211,376千円の減損処理を行っておりません。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物の種類ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。

前事業年度（平成23年3月31日現在）

該当事項はありません。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

株式関連

(単位：千円)

区分	デリバティブ 取引の種類等	契約額等	時価	評価損益
		うち1年超		

市場取引 以外の 取引	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	1,669,315	-	87,535	87,535
合計		1,669,315	-	87,535	87,535

（注）時価の算定方法は、東京証券取引所から公表された価格により評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は次のとおりであります。

前事業年度（平成23年3月31日現在）

株式関連

（単位：千円）

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ 取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等		時価
				うち1年超	
原則的 処理 方法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	2,435,030	-	183,430
合計			2,435,030	-	183,430

（注）時価の算定方法は、東京証券取引所から公表された価格により評価しております。

当事業年度（平成24年3月31日現在）

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、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
退職給付債務	1,410,635千円	1,670,344千円
退職給付引当金	1,410,635千円	1,670,344千円

3. 退職給付費用に関する事項

	前事業年度 （自平成22年4月1日 至平成23年3月31日）	当事業年度 （自平成23年4月1日 至平成24年3月31日）
勤務費用	191,300千円	261,341千円
その他	143,564千円	160,689千円
退職給付費用	334,864千円	422,030千円

（注）「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

（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：千円）

	前事業年度（平成23年3月31日 現在）	当事業年度（平成24年3月31日 現在）
繰延税金資産		
減損損失	928,499	838,826
退職給付引当金	573,987	599,247
連結法人間取引（譲渡損）	294,850	258,256
未払事業税	212,062	212,753
投資有価証券評価損	216,468	191,138
本社移転関連費用引当金	-	131,676
賞与引当金	107,014	116,690
出資金評価損	128,238	114,425
資産除去債務	-	110,989
有価証券評価損	-	80,344
器具備品	38,093	33,365
その他有価証券評価差額金	125,395	27,099
役員退職慰労引当金	24,072	25,804
未払社会保険料	11,722	14,071
その他	28,763	27,487
繰延税金資産小計	2,689,169	2,782,177
評価性引当額	1,547,609	1,379,241
繰延税金資産合計	1,141,560	1,402,935
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	2,772,301	2,428,233
建物（資産除去債務）	-	76,837
繰延ヘッジ損益	58,934	29,783
その他有価証券評価差額金	-	18,241
その他	2,156	1,888
繰延税金負債合計	2,833,392	2,554,985
繰延税金負債の純額	1,691,832	1,152,049

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

（単位：%）

	前事業年度 （平成23年3月31日現在）	当事業年度 （平成24年3月31日現在）
法定実効税率	40.69	-
（調整）		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.21	-
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	1.25	-
住民税均等割	0.02	-
評価性引当額	4.14	-

その他	0.07	-
税効果会計適用後の法人税等の負担率	35.60	-

（注）当事業年度は、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。

3．法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、35.6%となります。

この税率の変更により繰延税金負債の純額（繰延税金資産の金額を控除した金額）が211,604千円減少し、法人税等調整額が205,949千円減少しております。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を1年1ヶ月と見積り、過去の不動産賃貸借契約に係る原状回復費用の実績をもとに資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから割引前の見積り額を計上しております。

3．当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

変動の内容	前事業年度 （自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）	当事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）
期首残高	-	-
見積りの変更に伴う増加額	-	292,000
期末残高	-	292,000

4．当該資産除去債務の金額の見積りの変更

当事業年度において、平成24年度中に予定している本社移転計画により、合理的な見積りが可能となったため、当該資産除去債務292,000千円を貸借対照表に計上しております。

（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 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	35,468	35,468

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	76,217	76,217

〔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 平成22年4月1日 至 平成23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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
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	1,384,110	-	-
子会社	Daiwa Asset Management (India) Private Limited	India	1,128	金融商品取引業	(所有) 直接 91.0	経営管理	増資の引受	3,204,985	-	-

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (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等に関するMASへ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られております。
- (2) インド共和国における外国資本規制上の最低払込金額を満たすため、当社がDaiwa Asset Management(India)Private Limited社の行った増資を1株につき72円86銭で引き受けております。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
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)	1,372,770	-	-

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等に関するMASへ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られております。

(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 平成22年4月1日 至 平成23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 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	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	21,941,957	未払手数料	2,760,790
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケッツ㈱	東京都千代田区	255,700	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	666,862	未払手数料	70,947
							為替予約	1,160,187	-	-

同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研	東京都江東区	1,000	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	1,085,626	未払費用	129,623
-------------	---------	--------	-------	---------	---	-----------	-----------	-----------	------	---------

(注) 1. 上記の金額のうち、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。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 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兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

(2) 為替予約取引の条件は、市場実勢を勘案して決定しております。

(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。

当事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24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(千円)	科目	期末残高(千円)
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	19,792,278	未払手数料	2,376,978
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケット(株)	東京都千代田区	255,700	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	595,391	未払手数料	76,686
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	1,233,996	未払費用	245,735

(注) 1. 上記の金額のうち、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。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 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兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

(2) 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。

(3) 大和証券株式会社及び大和証券キャピタル・マーケット株式会社は、平成24年4月1日をもって合併いたしました。

2. 親会社に関する注記

(株)大和証券グループ本社(東京証券取引所、大阪証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1 株当たり情報)

前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
1株当たり純資産額 14,146.05円 1株当たり当期純利益 3,529.09円	1株当たり純資産額 13,358.92円 1株当たり当期純利益 2,692.30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. 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 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
当期純利益(千円)	9,205,730	7,022,948
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。

(追加情報)

前事業年度(自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)

当社及び株式会社大和証券グループ本社(以下、総称して「大和証券グループ」)は、株式会社新生銀行傘下で、インド共和国においてアセットマネジメント事業を行っているShinsei Asset Management (India) Private Limited(以下、「SAMI」)及びShinsei Trustee Company (India) Private Limited(以下、「STC」)の全株式を株式会社新生銀行及びその他の株主から取得いたしました。

本件について、平成22年12月20日に買収手続きを完了した後、「SAMI」及び「STC」は、Daiwa Asset Management (India) Private Limited(以下、「DAMI」)及びDaiwa Trustee Company (India) Private Limited(以下、「DTC」)として商号を変更しました。その後、インドにおける外国資本規制上の最低払込金額を満たすために、平成23年1月31日に増資を行っております。「DAMI」及び「DTC」は大和証券グループの100%子会社であり、当社の取得原価、増資の引受、貸借対照表計上額並びに出資比率は下記のとおりであります。

(単位：千円)

	DAMI	DTC
取得原価	1,059,552	2,717
増資の引受	3,204,985	9,944
貸借対照表計上額(注) 関係会社株式	4,391,020	13,037
出資比率	91.0%	99.9%

(注) 取得付随費用を算入した後の金額になります。

当事業年度(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

該当事項はありません。

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成24年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		1,833,296
有価証券		16,491,682
未収委託者報酬		6,074,374
貯蔵品		9,897
繰延税金資産		576,334
その他		421,905
流動資産計		25,407,491
固定資産		
有形固定資産	1	812,139
無形固定資産		
ソフトウェア		2,304,771
その他		710,794
無形固定資産合計		3,015,566
投資その他の資産		
投資有価証券		13,513,781
その他	1	2,247,303
貸倒引当金		9,950
投資その他の資産合計		15,751,135
固定資産計		19,578,842
資産合計		44,986,333

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成24年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		4,702,038
未払費用		3,673,584
未払法人税等		743,636
賞与引当金		426,400
本社移転関連費用引当金		346,425
資産除去債務		292,000
その他	3	270,950
流動負債計		10,455,035
固定負債		
繰延税金負債		1,465,584
退職給付引当金		1,864,115
役員退職慰労引当金		47,925

固定負債計	3,377,624
負債合計	13,832,659
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	374,297
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	4,314,536
利益剰余金合計	4,688,834
株主資本合計	31,358,834
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	408,812
繰延ヘッジ損益	203,652
評価・換算差額等合計	205,160
純資産合計	31,153,673
負債・純資産合計	44,986,333

(2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		35,929,057
その他営業収益		221,982
営業収益計		36,151,039
営業費用		
支払手数料		20,053,264
その他営業費用		5,549,289
営業費用計		25,602,554
一般管理費	1	5,244,843
営業利益		5,303,641
営業外収益	2	410,550
営業外費用	1, 3	62,244
経常利益		5,651,948
特別利益		39,827
特別損失		14,428
税引前中間純利益		5,677,347
法人税、住民税及び事業税		2,153,585
法人税等調整額		97,806
中間純利益		3,621,569

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)
株主資本	
資本金	
当期首残高	15,174,272
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	11,495,727
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,495,727
資本剰余金合計	
当期首残高	11,495,727
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	374,297
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	374,297
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	
当期首残高	7,715,116
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,022,149
中間純利益	3,621,569
当中間期変動額合計	3,400,580
当中間期末残高	4,314,536

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)
利益剰余金合計	
当期首残高	8,089,414
当中間期変動額	

剰余金の配当	7,022,149
中間純利益	3,621,569
当中間期変動額合計	3,400,580
当中間期末残高	4,688,834
株主資本合計	
当期首残高	34,759,414
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,022,149
中間純利益	3,621,569
当中間期変動額合計	3,400,580
当中間期末残高	31,358,834
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	33,879
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	442,692
当中間期変動額合計	442,692
当中間期末残高	408,812
繰延ヘッジ損益	
当期首残高	53,783
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	149,868
当中間期変動額合計	149,868
当中間期末残高	203,652
評価・換算差額等合計	
当期首残高	87,663
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	292,823
当中間期変動額合計	292,823
当中間期末残高	205,160
純資産合計	
当期首残高	34,847,077
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,022,149
中間純利益	3,621,569
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	292,823
当中間期変動額合計	3,693,404
当中間期末残高	31,153,673

重要な会計方針

	当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)
1. 資産の評価基準及び 評価方法	<p>(1) 有価証券 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法により計上しております。 その他有価証券 時価のあるもの 中間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。</p> <p>(2) デリバティブ 時価法により計上しております。</p>
2. 固定資産の減価償却 の方法	<p>(1) 有形固定資産及び投資不動産 定率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 6～47年 器具備品 3～20年</p> <p>(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）に基づいております。</p> <p>(3) 長期前払費用 定額法によっております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率 法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評 価法により計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会 計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 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中 間会計期間未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ごと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中 間会計期間未要支給額を計上しております。</p> <p>(4) 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 程に基づく当中間会計期間未要支給額を計上しております。</p> <p>(5) 本社移転関連費用引当金 本社移転に伴い発生する損失に備えるため、発生が見込まれる固 定資産除却損、移転費用について合理的な見積額を計上しております。</p>

4．ヘッジ会計の方法	<p>(1) ヘッジ会計の方法 繰延ヘッジ処理によっております。</p> <p>(2) ヘッジ手段とヘッジ対象 ヘッジ手段・・・株価指数先物 ヘッジ対象・・・投資有価証券</p> <p>(3) ヘッジ方針 価格変動リスクを軽減する目的で、対象資産である投資有価証券の保有残高の範囲内でヘッジを行っております。</p> <p>(4) ヘッジ有効性評価の方法 原則として四半期毎にヘッジ手段の時価変動の累計とヘッジ対象の時価変動の累計を比較し、両者の変動額等を基礎にして、ヘッジ手段の有効性評価を行っております。</p>
5．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>(1) 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。</p> <p>(2) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。</p>

会計方針の変更等

<p>当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)</p>
<p>(会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年 4月 1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。 なお、この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微であります。</p>

注記事項

(中間貸借対照表関係)

<p>当中間会計期間末 (平成24年 9月30日)</p>	
1．減価償却累計額	
有形固定資産	3,428,406千円
投資その他の資産	741,362千円
2．債務保証	<p>子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,329,090千円に対して保証を行っております。</p>
3．消費税等の取扱い	<p>仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。</p>

(中間損益計算書関係)

<p>当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)</p>	
1．減価償却累計額	

有形固定資産	207,578千円
無形固定資産	440,371千円
投資その他の資産	7,190千円
2. 営業外収益の主要項目	
受取配当金	219,419千円
投資有価証券売却益	90,397千円
有価証券償還益	64,318千円
3. 営業外費用の主要項目	
有価証券償還損	35,545千円
投資不動産管理費用	7,903千円
投資不動産償却費	6,376千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（千株）	当中間会計期間 増加株式数（千株）	当中間会計期間 減少株式数（千株）	当中間会計期間末 株式数（千株）
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

配当金支払額

（決議）	株式の種類	配当金の総額 （百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成24年6月25日 定時株主総会	普通株式	7,022	2,692	平成24年 3月31日	平成24年 6月26日

（金融商品関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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。また、デリバティブ取引は、事業遂行上生じた市場リスクヘッジのために利用し、投機的な取引は行いません。

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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、投資信託、株式であります。投資信託は余資運用及び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す。

未払金は主に投資信託の販売に係る手数料及び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。

デリバティブ取引は株式先物取引を行っております。当社ではこれらをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、ヘッジ会計を適用しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「4．ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

(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、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、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、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し、繰延ヘッジ処理を行っております。

() デリバティブ取引

デリバティブ取引に関しては、ヘッジ手段に用いる場合にのみ限定しております。取引の執行・管理については財務リスク管理規程に従って行っており、取引の状況を財務会議において報告しております。

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財務会議において報告を行っております。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「2．金融商品の時価等に関する事項」における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。

2．金融商品の時価等に関する事項

平成24年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。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）。

（単位：千円）

	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	1,833,296	1,833,296	-
(2) 未収委託者報酬	6,074,374	6,074,374	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	23,805,225	23,805,225	-

資産計	31,712,896	31,712,896	-
(1) 未払金	4,702,038	4,702,038	-
(2) 未払費用(*1)	2,991,665	2,991,665	-
負債計	7,693,704	7,693,704	-
デリバティブ取引(*2)			
ヘッジ会計が適用されていないもの	-	-	-
ヘッジ会計が適用されているもの	(2,304)	(2,304)	-
デリバティブ取引計	(2,304)	(2,304)	-

(*1) 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。

(*2) デリバティブ取引によって生じた正味の債権・債務は純額で表示しており、合計で正味の債務となる項目については、()で示しております。

<注1>金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

資産

(1) 現金・預金、及び(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、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) 未払金、及び(2) 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。

デリバティブ取引

注記事項「デリバティブ取引関係」をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	1,059,169
子会社株式	5,141,069
長期差入保証金	1,587,878

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

（単位：千円）

	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	1,833,296	-	-	-
未収委託者報酬	6,074,374	-	-	-
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	267,222	1,676,395	3,587,421	-
合計	8,174,892	1,676,395	3,587,421	-

（有価証券関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式（中間貸借対照表計上額 5,141,069千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
証券投資信託の受益証券	2,985,292	2,807,373	177,919
小計	2,985,292	2,807,373	177,919
中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
株式	31,019	55,101	24,082
証券投資信託の受益証券	20,788,914	21,578,724	789,810
小計	20,819,933	21,633,826	813,892
合計	23,805,225	24,441,199	635,973

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 1,059,169千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

該当する取引はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引について、ヘッジ会計の方法ごとの決算日における契約額又は契約において定められた元本相当額等は次のとおりであります。

株式関連

（単位：千円）

ヘッジ 会計の 方法	デリバティブ 取引の種類等	主な ヘッジ 対象	契約額等		時価	当該時価の 算定方法
				うち1年超		
原則的 処理方 法	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	投資 有価証券	1,408,896	-	2,304	東京証券取引所から公表された価格 によっている。
合計			1,408,896	-	2,304	

（資産除去債務関係）

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1．当該資産除去債務の概要

本社の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

2．当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を平成23年12月から平成24年12月までの1年1ヶ月と見積り、過去の不動産賃貸借契約に係る原状回復費用の実績をもとに資産除去債務の金額を計算しております。なお、割引計算による金額の重要性が乏しいことから割引前の見積り額を計上しております。

3．当該資産除去債務の総額の増減

変動の内容	金額
期首残高	292,000千円
時の経過による調整額	-
中間期末残高	292,000千円

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

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]

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1．サービスごとの情報

当社のサービスは、単一であ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

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間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中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、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、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[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]

当中間会計期間（自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30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]

当中間会計期間（自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日）

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]

当中間会計期間（自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日）

該当事項はありません。

（１株当たり情報）

当中間会計期間 （自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日）	
1株当たり純資産額	11,943.02円
1株当たり中間純利益金額	1,388.35円
(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。	
2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。	
中間純利益(千円)	3,621,569
普通株式に係る中間純利益(千円)	3,621,569
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	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

平成24年12月3日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・本店の所在地の変更(東京都千代田区に変更)

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または重要な影響を及ぼすことが予想される事実

提出日前1年以内において、訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または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（平成24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 （平成24年4月 1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（平成24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。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用することがあります。

(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

平成25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 貞廣 篤典 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（一般財形30）の平成24年2月2日から平成25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（一般財形30）の平成25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）財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）](#)△

独立監査人の監査報告書

平成24年 5月25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 森 公高 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 貞廣 篤典 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 内田 和男 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平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第53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平成24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)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。

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年11月29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	森 公 高 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞 廣 篤 典 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内 田 和 男 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、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な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、大和証券投資信託委託株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注)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。