

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成29年4月24日提出
【計算期間】	第23計算期間 (自 平成28年2月2日 至 平成29年2月1日)
【ファンド名】	財形株投（一般財形30）
【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 岩本 信之
【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】	山村 政
【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
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

##### (注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「国内」...目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「資産複合」...目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

##### (注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」...組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分固定型」...目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- ・「年1回」...目論見書等において、年1回決算する旨の記載があるもの
- ・「日本」...目論見書等において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」...目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの

## 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国内	株式
追加型投信	海外	債券
	内外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態
株式	年1回	グローバル	ファミリー ファンド
一般 大型株 中小型株	年2回	日本	
債券	年4回	北米	
一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州	
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア	ファンド・オブ・ ファンズ
その他資産 (投資信託証券) (資産複合 資産配分) (固定型(株式、債券))	日々	オセアニア	
資産複合 ( )	その他 ( )	中南米	
資産配分固定型		アフリカ	
資産配分変更型		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。

## &lt; 信託金の限度額 &gt;

- ・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。

## &lt; ファンドの特色 &gt;

## 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。

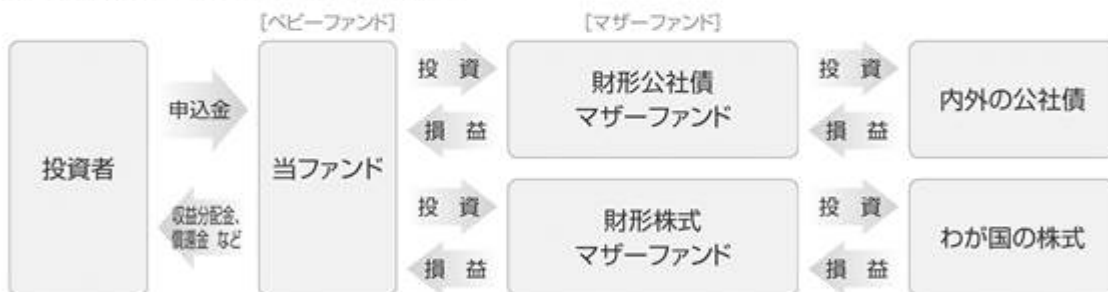
※東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所の第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額を指数化し、市場全体の株価の変動をとらえようとするものです。

- 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。積立ては、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	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1）に基づき、次の業務を行いません。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 3）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2）の委託者であり、次の業務を行いません。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2 損益 信託金（ 3）	
受託会社	<p>みずほ信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社：資産管理サービス信託銀行株式会社</p>	<p>信託契約（ 2）の受託者であり、次の業務を行いません。なお、信託事務の一部につき資産管理サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
損益 投資		
投資対象	<p>内外の公社債、わが国の株式 など （ファミリーファンド方式で運用を行いません。）</p>	

（注）収益分配金は自動的に再投資されます。

1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。

- 2: 「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項(運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等)が規定されています。
- 3: 販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を經由して、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收受します。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29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	%
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	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。

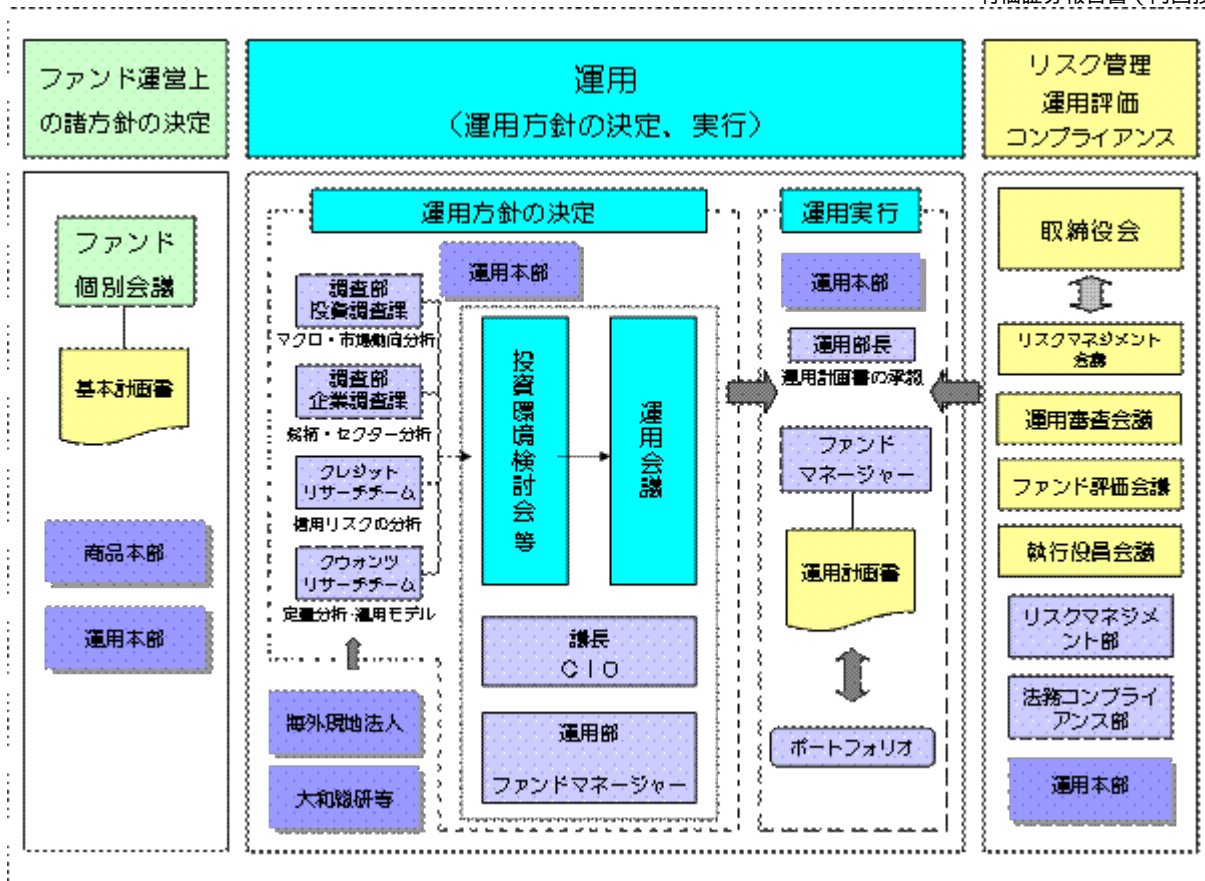
委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

#### ハ．基本的な運用方針の決定

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

#### ニ．運用計画書の作成・承認

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

### 職務権限

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

#### イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更



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

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

イ．ファンド評価会議

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

ロ．運用審査会議

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

ハ．リスクマネジメント会議

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

ニ．執行役員会議

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

受託会社に対する管理体制

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

上記の運用体制は平成29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、

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

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

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

先物取引等（信託約款）

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、および信託財産が運用対象とする有価証券の価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取扱うものとします（以下同じ。）。)

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

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

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

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

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

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

#### スワップ取引（信託約款）

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

#### デリバティブ取引等（信託約款）

委託会社は、デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなる投資の指図をしません。

#### 同一銘柄の転換社債等（信託約款）

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

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

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

#### 有価証券の貸付け（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付けることの指図をすることができます。

1．株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

2．公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

ロ．前イ．に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

ハ．委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

#### 外貨建資産（信託約款）

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

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

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

#### 外国為替予約の指図（信託約款）

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

#### 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。

- 八．収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- 二．借入金の利息は信託財産中より支弁します。

## < 参 考 > マザーファンドの概要

### 1．財形公社債マザーファンド

#### (1) 投資方針

主要投資対象

内外の公社債を主要投資対象とします。

投資態度

主として内外の公社債への投資により、安定した収益の確保をはかります。

#### (2) 投資対象

委託会社は、信託金を、主として次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 1．国債証券
  - 2．地方債証券
  - 3．特別の法律により法人の発行する債券
  - 4．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券を除きます。新株予約権付社債については、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）に限ります。）
  - 5．コマーシャル・ペーパー
  - 6．外国または外国の者の発行する証券で、前1.から前5.までの証券の性質を有するもの
  - 7．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  - 8．外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - 9．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  - 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



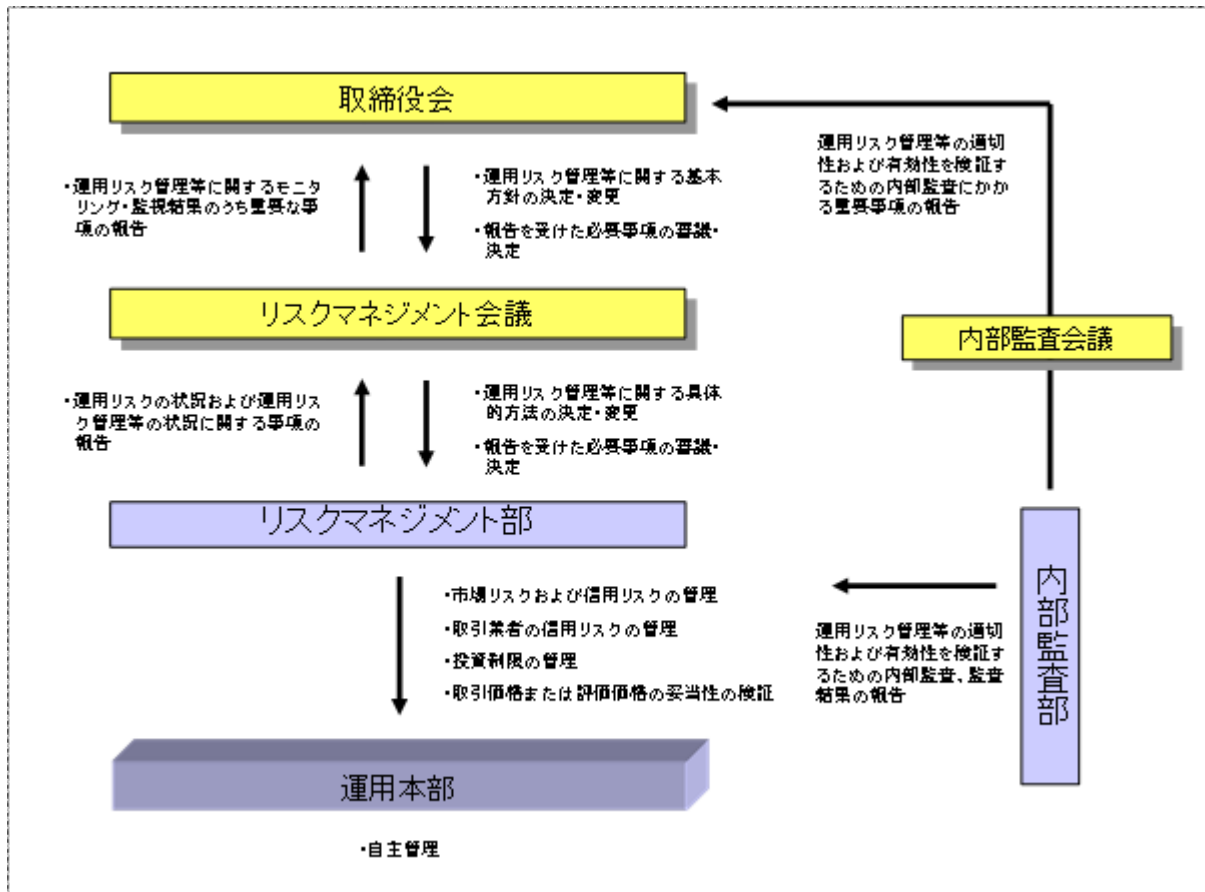
金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

### (3) その他の留意点

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

### (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



#### 流動性リスクに対する管理体制

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

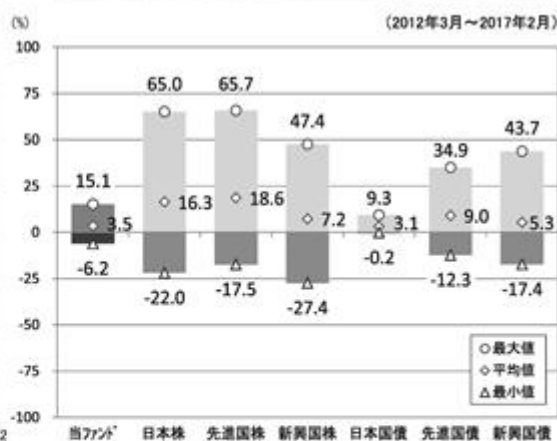
## 参 考 情 報

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

## ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



## 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

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

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

## ※資産クラスについて

日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）

先進国株：MSCIコクサイ・インデックス（配当込み、円ベース）

新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）

日本国債：NOMURA-BPI国債

先進国債：シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

## ※指数について

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

## 4 【手数料等及び税金】

## (1) 【申込手数料】

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

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

## (2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

### (3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.5876%（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0.3311%（税抜）	年率1.0639%（税抜）	年率0.075%（税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

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

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

販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

### (4) 【その他の手数料等】

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

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息ならびに信託財産にかかる監査報酬および当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

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

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

## &lt; マザーファンドより支弁する手数料等 &gt;

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、平成49年12月31日まで20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%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、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

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

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。

## &lt; 注1 &gt; 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。

## &lt; 注2 &gt; 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29年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】（平成29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	538,575,079	96.77
内 日本	538,575,079	96.77
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	17,949,096	3.23
純資産総額	556,524,175	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29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	281,933,547	1.3281 374,435,943	1.3306 375,140,777	67.41
2 財形株式マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	118,921,853	1.3663 162,482,928	1.3743 163,434,302	29.37

(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	96.77%
合計	96.77%

(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
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
第20計算期間末 (平成26年2月3日)	560,637,749	560,637,749	0.9318	0.9318
第21計算期間末 (平成27年2月2日)	587,612,329	587,612,329	0.9780	0.9780
第22計算期間末 (平成28年2月1日)	573,773,013	573,773,013	0.9910	0.9910
平成28年2月末日	557,812,705	-	0.9609	-
3月末日	562,754,067	-	0.9721	-
4月末日	559,390,441	-	0.9700	-
5月末日	556,808,342	-	0.9782	-
6月末日	547,002,781	-	0.9533	-
7月末日	555,177,909	-	0.9662	-
8月末日	550,439,384	-	0.9638	-
9月末日	534,187,099	-	0.9651	-
10月末日	541,332,628	-	0.9769	-
11月末日	548,365,180	-	0.9883	-
12月末日	559,006,238	-	0.9970	-
平成29年1月末日	554,587,859	-	0.9948	-

第23計算期間末 (平成29年2月1日)	555,227,290	555,227,290	0.9959	0.9959
2月末日	556,524,175	-	0.9978	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第20計算期間	0.0000
第21計算期間	0.0000
第22計算期間	0.0000
第23計算期間	0.0000

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
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
第20計算期間	7.2
第21計算期間	5.0
第22計算期間	1.3
第23計算期間	0.5

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第20計算期間	59,122,547	48,167,898
第21計算期間	57,288,762	58,139,235
第22計算期間	51,672,462	73,532,418
第23計算期間	52,787,167	74,271,591

## (参考) マザーファンド

## 財形公社債マザーファンド

## (1) 投資状況 (平成29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	929,477,910	75.04
内 日本	929,477,910	75.04
地方債証券	262,362,476	21.18
内 日本	262,362,476	21.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	46,835,386	3.78
純資産総額	1,238,675,772	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29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 17 物価連動国債	日本	国債証券	50,000,000	107.68 53,843,250	107.63 53,817,500	0.100000 2023/09/10	4.34
2 335 10年国債	日本	国債証券	40,000,000	103.57 41,430,400	104.05 41,620,400	0.500000 2024/09/20	3.36
3 345 10年国債	日本	国債証券	40,000,000	100.09 40,038,800	100.48 40,194,800	0.100000 2026/12/20	3.24

4	325 10年国債	日本	国債証券	35,000,000	104.88 36,709,750	105.08 36,779,400	0.800000 2022/09/20	2.97
5	310 10年国債	日本	国債証券	35,000,000	104.13 36,447,950	104.18 36,463,700	1.000000 2020/09/20	2.94
6	318 10年国債	日本	国債証券	30,000,000	105.08 31,526,700	105.22 31,567,200	1.000000 2021/09/20	2.55
7	303 10年国債	日本	国債証券	30,000,000	104.15 31,247,100	104.14 31,243,800	1.400000 2019/09/20	2.52
8	339 10年国債	日本	国債証券	30,000,000	102.91 30,875,700	103.36 31,008,900	0.400000 2025/06/20	2.50
9	338 10年国債	日本	国債証券	30,000,000	102.87 30,861,900	103.34 31,003,200	0.400000 2025/03/20	2.50
10	299 10年国債	日本	国債証券	30,000,000	103.20 30,962,700	103.19 30,957,600	1.300000 2019/03/20	2.50
11	343 10年国債	日本	国債証券	30,000,000	100.23 30,069,600	100.60 30,180,600	0.100000 2026/06/20	2.44
12	106 5年国債	日本	国債証券	30,000,000	100.32 30,096,000	100.24 30,074,700	0.200000 2017/09/20	2.43
13	105 5年国債	日本	国債証券	30,000,000	100.19 30,057,300	100.13 30,040,500	0.200000 2017/06/20	2.43
14	104 5年国債	日本	国債証券	30,000,000	100.06 30,018,600	100.02 30,006,300	0.200000 2017/03/20	2.42
15	27 - 2 熊本県公債	日本	地方債証券	27,690,000	102.38 28,351,264	102.77 28,457,566	0.476000 2025/10/30	2.30
16	332 10年国債	日本	国債証券	27,000,000	104.26 28,152,630	104.61 28,246,050	0.600000 2023/12/20	2.28
17	24 - 13 愛知県公債	日本	地方債証券	27,000,000	104.09 28,104,921	104.26 28,152,090	0.772000 2022/11/30	2.27
18	315 10年国債	日本	国債証券	25,000,000	105.75 26,439,750	105.82 26,455,250	1.200000 2021/06/20	2.14
19	312 10年国債	日本	国債証券	25,000,000	105.16 26,290,250	105.20 26,300,750	1.200000 2020/12/20	2.12
20	305 10年国債	日本	国債証券	25,000,000	104.23 26,058,500	104.22 26,056,750	1.300000 2019/12/20	2.10
21	314 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	105.05 21,011,000	105.11 21,022,600	1.100000 2021/03/20	1.70
22	334 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	104.27 20,854,200	104.72 20,944,800	0.600000 2024/06/20	1.69
23	328 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	103.99 20,798,400	104.26 20,852,000	0.600000 2023/03/20	1.68

24	309 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	104.22 20,844,400	104.23 20,846,600	1.100000 2020/06/20	1.68
25	21 - 11 千葉県公債	日本	地方債証券	20,000,000	104.15 20,831,500	104.10 20,821,920	1.420000 2020/01/24	1.68
26	336 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	103.61 20,722,200	104.10 20,820,800	0.500000 2024/12/20	1.68
27	301 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	104.02 20,804,000	104.00 20,800,400	1.500000 2019/06/20	1.68
28	26 - 3 千葉県公債	日本	地方債証券	20,000,000	103.35 20,671,000	103.82 20,764,720	0.611000 2024/07/25	1.68
29	340 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	102.91 20,583,600	103.37 20,675,400	0.400000 2025/09/20	1.67
30	298 10年国債	日本	国債証券	20,000,000	102.88 20,576,600	102.85 20,570,600	1.300000 2018/12/20	1.66

(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	75.04%
地方債証券	21.18%
合計	96.22%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### 財形株式マザーファンド

#### (1) 投資状況（平成29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	817,934,620	98.05
内 日本	817,934,620	98.05
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	16,243,577	1.95
純資産総額	834,178,197	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)	13,806,000	1.66
内 日本	13,806,000	1.66

(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29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	4,400	6,546.00 28,802,400	6,365.00 28,006,000	3.36
2 三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	26,600	727.40 19,348,840	738.40 19,641,440	2.35
3 ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通 信業	1,600	8,805.00 14,088,000	8,362.00 13,379,200	1.60
4 日本電信電話	日本	株式	情報・通 信業	2,800	4,958.00 13,882,400	4,751.00 13,302,800	1.59
5 三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,900	4,413.00 12,797,700	4,377.00 12,693,300	1.52
6 本田技研	日本	株式	輸送用 機器	3,200	3,415.00 10,928,000	3,489.00 11,164,800	1.34
7 KDDI	日本	株式	情報・通 信業	3,400	3,036.00 10,322,400	2,939.00 9,992,600	1.20
8 みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	46,700	208.70 9,746,290	209.70 9,792,990	1.17

9	ファナック	日本	株式	電気機器	400	22,155.00 8,862,000	22,125.00 8,850,000	1.06
10	ソニー	日本	株式	電気機器	2,500	3,410.00 8,525,000	3,478.00 8,695,000	1.04
11	キーエンス	日本	株式	電気機器	200	43,860.00 8,772,000	43,460.00 8,692,000	1.04
12	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	2,200	3,631.00 7,988,200	3,757.00 8,265,400	0.99
13	東日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	700	10,320.00 7,224,000	10,155.00 7,108,500	0.85
14	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	2,600	2,717.00 7,064,200	2,667.00 6,934,200	0.83
15	東京海上HD	日本	株式	保険業	1,400	4,730.00 6,622,000	4,919.00 6,886,600	0.83
16	三菱商事	日本	株式	卸売業	2,700	2,573.00 6,947,100	2,534.50 6,843,150	0.82
17	武田薬品	日本	株式	医薬品	1,300	4,768.00 6,198,400	5,222.00 6,788,600	0.81
18	信越化学	日本	株式	化学	700	9,766.00 6,836,200	9,503.00 6,652,100	0.80
19	セブン&アイ・HLDGS	日本	株式	小売業	1,500	4,558.00 6,837,000	4,400.00 6,600,000	0.79
20	三菱地所	日本	株式	不動産業	3,000	2,159.50 6,478,500	2,195.00 6,585,000	0.79
21	村田製作所	日本	株式	電気機器	400	14,640.00 5,856,000	16,150.00 6,460,000	0.77
22	三菱電機	日本	株式	電気機器	3,800	1,742.50 6,621,500	1,647.50 6,260,500	0.75
23	キヤノン	日本	株式	電気機器	1,900	3,292.00 6,254,800	3,281.00 6,233,900	0.75
24	ブリヂストン	日本	株式	ゴム製品	1,300	4,153.00 5,398,900	4,481.00 5,825,300	0.70
25	花王	日本	株式	化学	1,000	5,624.00 5,624,000	5,801.00 5,801,000	0.70
26	アステラス製薬	日本	株式	医薬品	3,800	1,465.00 5,567,000	1,512.00 5,745,600	0.69
27	日立	日本	株式	電気機器	9,000	648.20 5,833,800	618.80 5,569,200	0.67
28	東海旅客鉄道	日本	株式	陸運業	300	18,505.00 5,551,500	18,380.00 5,514,000	0.66

29	野村ホールディングス	日本	株式	証券、商 品先物 取引業	7,400	721.20 5,336,880	729.30 5,396,820	0.65
30	ダイキン工業	日本	株式	機械	500	11,340.00 5,670,000	10,665.00 5,332,500	0.64

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	98.05%
合計	98.05%

(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	0.09%
鉱業	0.29%
建設業	2.94%
食料品	4.35%
繊維製品	0.91%
パルプ・紙	0.22%
化学	7.02%
医薬品	4.60%
石油・石炭製品	0.59%
ゴム製品	0.97%
ガラス・土石製品	0.92%
鉄鋼	1.31%
非鉄金属	1.00%
金属製品	0.65%
機械	4.93%
電気機器	12.19%
輸送用機器	9.08%
精密機器	1.43%
その他製品	1.57%
電気・ガス業	1.75%
陸運業	4.22%
海運業	0.28%
空運業	0.51%

倉庫・運輸関連業	0.04%
情報・通信業	7.50%
卸売業	4.56%
小売業	4.76%
銀行業	8.33%
証券、商品先物取引業	1.18%
保険業	2.59%
その他金融業	1.18%
不動産業	2.45%
サービス業	3.65%
合計	98.05%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	ミニTOPIX先物 2017年3 月	買建	9	13,798,858	13,806,000	1.66%

(注1) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率です。

(注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

#### (参考情報) 運用実績

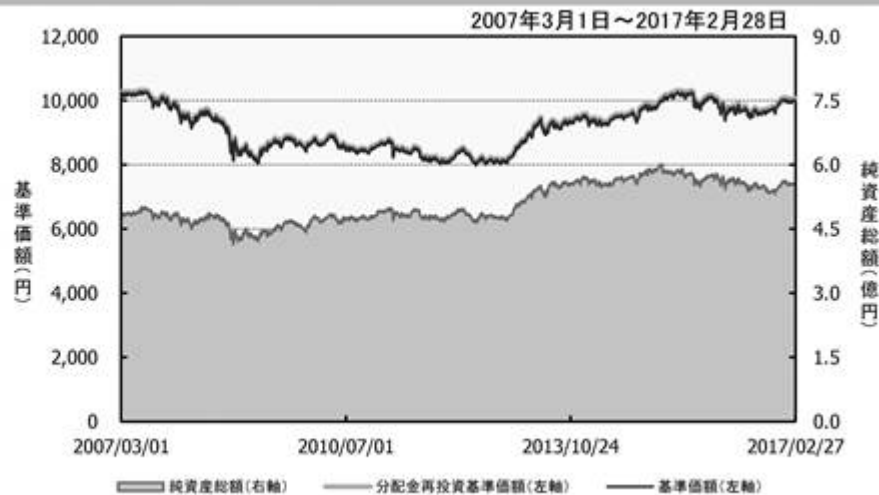
2017年2月28日現在

※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	9,978円
純資産総額	5.5億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.3%
3カ月間	1.0%
6カ月間	3.5%
1年間	3.8%
3年間	6.6%
5年間	18.8%
設定来	0.5%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 65円

決算期	第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	第20期 14年2月	第21期 15年2月	第22期 16年2月	第23期 17年2月
分配金	5円	5円	5円	0円	0円	0円	0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	57	64.9%	直接利回り(%)	電気機器	3.6%	トヨタ自動車	輸送用機器	1.0%
国内株式・先物	619	29.3%	最終利回り(%)	輸送用機器	2.7%	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	0.7%
			修正デュレーション	銀行業	2.4%	ミニTPX先物 2903月	-	0.5%
コール・ローン、その他		6.3%	残存年数	情報・通信業	2.2%	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.5%
合計	676	-	債券格付別構成	化学	2.1%	日本電信電話	情報・通信業	0.5%
			AAA	機械	1.4%	三井住友フィナンシャルG	銀行業	0.4%
株式市場・上場別構成			AA	小売業	1.4%	本田技研	輸送用機器	0.4%
一部(東証・名証)		28.8%	A	医薬品	1.3%	KDDI	情報・通信業	0.4%
二部(東証・名証)		-	BBB	卸売業	1.3%	みずほフィナンシャルG	銀行業	0.3%
新興市場他		-	BB以下・無格付	その他	10.3%	ファナック	電気機器	0.3%
その他		-	合計	合計	28.8%	合計	合計	5.0%
合計		28.8%	合計	合計	100.0%	合計	合計	

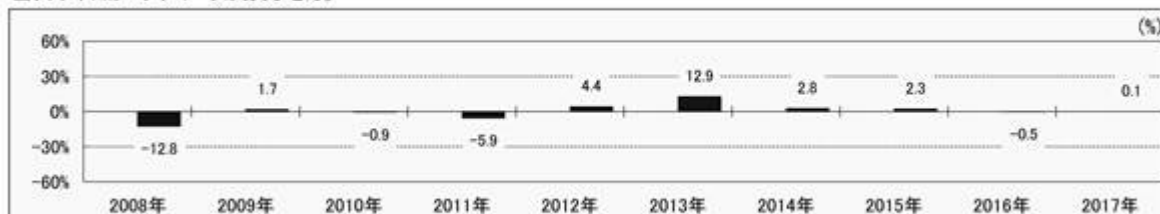
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。無格付債券を10.2%保有しております。

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

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2017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す。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

### 2 【換金(解約)手続等】

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

#### イ．一部解約

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

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <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たものとして、当該計算日の基準価額とします。

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

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

#### ロ．買取り

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

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

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

受益者は、買取価額を、販売会社に問い合わせることにより知ることができます。

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

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

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

純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

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

なお、外貨建資産（外国通貨表示の有価証券（以下「外貨建有価証券」といいます。））、預金その他の資産をいいます。以下同じ。）の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先（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、この4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

## 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるとときは、前1.の信託約款の変更をしません。

5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。

#### 反対者の買取請求権

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

#### 運用報告書

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

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

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

#### 公告

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

<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。)を持分に依り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てします。)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23期計算期間(平成28年2月2日から平成29年2月1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）

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第22期 平成28年2月1日現在	第23期 平成29年2月1日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	15,891,736	21,216,719
親投資信託受益証券	562,391,410	538,393,507
流動資産合計	578,283,146	559,610,226
資産合計	578,283,146	559,610,226
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	229,290	222,816
未払委託者報酬	4,265,571	4,145,361
その他未払費用	15,272	14,759
流動負債合計	4,510,133	4,382,936
負債合計	4,510,133	4,382,936
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 578,973,783	1 557,489,359
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 5,200,770	2 2,262,069
（分配準備積立金）	41,800,661	40,225,739
元本等合計	573,773,013	555,227,290
純資産合計	573,773,013	555,227,290
負債純資産合計	578,283,146	559,610,226



## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第22期		第23期	
	自	平成27年2月3日 至 平成28年2月1日	自	平成28年2月2日 至 平成29年2月1日
<b>営業収益</b>				
受取利息		11,052		209
有価証券売買等損益		17,501,026		11,002,097
<b>営業収益合計</b>		<b>17,512,078</b>		<b>11,002,306</b>
<b>営業費用</b>				
支払利息		-		6,978
受託者報酬		465,102		446,869
委託者報酬		8,652,418		8,313,481
その他費用		30,825		29,797
<b>営業費用合計</b>		<b>9,148,345</b>		<b>8,797,125</b>
<b>営業利益</b>		<b>8,363,733</b>		<b>2,205,181</b>
経常利益		8,363,733		2,205,181
<b>当期純利益</b>		<b>8,363,733</b>		<b>2,205,181</b>
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（ ）		2,087,821		1,352,900
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		13,221,410		5,200,770
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,744,728		743,074
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,564,199		743,074
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		180,529		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,362,454
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,362,454
<b>分配金</b>		<b>1 -</b>		<b>1 -</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,200,770		2,262,069

## (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23期	
	自 平成28年2月2日	至 平成29年2月1日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第22期	第23期
	平成28年2月1日現在	平成29年2月1日現在
1. 1 期首元本額	600,833,739円	578,973,783円
期中追加設定元本額	51,672,462円	52,787,167円
期中一部解約元本額	73,532,418円	74,271,591円
2. 計算期間末日における受益権の総数	578,973,783口	557,489,359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5,200,770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2,262,069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22期	第23期
	自 平成27年2月3日 至 平成28年2月1日	自 平成28年2月2日 至 平成29年2月1日

1 分配金の計算過程	<p>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(4,648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(6,271,264円)、投資信託約款に規定される収益調整金(64,558,762円)及び分配準備積立金(35,524,749円)より分配対象額は106,359,423円(1万口当たり1,837.03円)であり、分配を行っておりません。</p>	<p>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(3,564,509円)、投資信託約款に規定される収益調整金(65,751,256円)及び分配準備積立金(36,661,230円)より分配対象額は105,976,995円(1万口当たり1,900.97円)であり、分配を行っておりません。</p>
------------	---	---

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	<p style="text-align: center;">第23期 自 平成28年2月2日 至 平成29年2月1日</p>
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、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。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。</p> <p>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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第23期
	平成29年2月1日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	第22期	第23期
	平成28年2月1日現在 当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	平成29年2月1日現在 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	14,198,688	12,313,335
合計	14,198,688	12,313,335

## （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22期	第23期
平成28年2月1日現在	平成29年2月1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23期
自 平成28年2月2日 至 平成29年2月1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22期	第23期
	平成28年2月1日現在	平成29年2月1日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9910円 (9,910円)	0.9959円 (9,959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	281,933,547	374,435,943	
	財形株式マザーファンド	120,001,145	163,957,564	
親投資信託受益証券 合計			538,393,507	
合計			538,393,507	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## (参考)

当ファンドは、「財形公社債マザーファンド」受益証券及び「財形株式マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

## 「財形公社債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成28年2月1日現在	平成29年2月1日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		

流動資産		
コール・ローン	73,097,695	44,176,248
国債証券	1,081,588,020	928,088,430
地方債証券	140,991,583	262,043,424
未収利息	2,638,967	2,033,629
前払費用	18,727	6,195
流動資産合計	1,298,334,992	1,236,347,926
資産合計	1,298,334,992	1,236,347,926
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	1 976,583,849	930,942,666
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	321,751,143	305,405,260
元本等合計	1,298,334,992	1,236,347,926
純資産合計	1,298,334,992	1,236,347,926
負債純資産合計	1,298,334,992	1,236,347,926

## 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28年2月2日 至 平成29年2月1日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び地方債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成28年2月1日現在	平成29年2月1日現在
1. 1 期首	平成27年2月3日	平成28年2月2日
期首元本額	953,772,193円	976,583,849円
期中追加設定元本額	34,231,827円	7,531,255円
期中一部解約元本額	11,420,171円	53,172,438円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
財形株投（一般財形50）	377,494,238円	355,054,693円
財形株投（一般財形30）	296,900,367円	281,933,547円
財形株投（年金・住宅財形30）	302,189,244円	293,954,426円
計	976,583,849円	930,942,666円
2. 期末日における受益権の総数	976,583,849口	930,942,666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28年2月2日 至 平成29年2月1日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年2月1日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成28年2月1日現在	平成29年2月1日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	5,955,155	9,487,740
地方債証券	372,936	1,483,530
合計	5,582,219	10,971,270

（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27年2月3日から平成28年2月1日まで、及び平成28年2月2日から平成29年2月1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28年2月1日現在	平成29年2月1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28年2月1日現在	平成29年2月1日現在
1口当たり純資産額	1.3295円	1.3281円
（1万口当たり純資産額）	(13,295円)	(13,281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	1 0 4 5 年国債	30,000,000	30,018,600	
	1 0 5 5 年国債	30,000,000	30,057,300	
	1 0 6 5 年国債	30,000,000	30,096,000	
	1 0 7 5 年国債	20,000,000	20,089,600	
	1 1 2 5 年国債	15,000,000	15,138,600	
	2 9 0 1 0 年国債	10,000,000	10,191,600	
	2 9 5 1 0 年国債	20,000,000	20,488,600	
	2 9 6 1 0 年国債	15,000,000	15,426,300	
	2 9 8 1 0 年国債	20,000,000	20,576,600	
	2 9 9 1 0 年国債	30,000,000	30,962,700	
	3 0 1 1 0 年国債	20,000,000	20,804,000	
	3 0 3 1 0 年国債	30,000,000	31,247,100	
	3 0 5 1 0 年国債	25,000,000	26,058,500	
	3 0 6 1 0 年国債	1,000,000	1,048,800	
	3 0 9 1 0 年国債	20,000,000	20,844,400	
	3 1 0 1 0 年国債	35,000,000	36,447,950	
	3 1 2 1 0 年国債	25,000,000	26,290,250	
	3 1 4 1 0 年国債	20,000,000	21,011,000	
	3 1 5 1 0 年国債	25,000,000	26,439,750	
	3 1 8 1 0 年国債	30,000,000	31,526,700	
	3 2 0 1 0 年国債	10,000,000	10,536,400	
	3 2 1 1 0 年国債	10,000,000	10,561,000	
	3 2 3 1 0 年国債	15,000,000	15,789,300	
	3 2 4 1 0 年国債	5,000,000	5,236,100	
	3 2 5 1 0 年国債	35,000,000	36,709,750	
	3 2 8 1 0 年国債	20,000,000	20,798,400	
	3 2 9 1 0 年国債	10,000,000	10,536,800	
	3 3 0 1 0 年国債	5,000,000	5,275,550	
	3 3 2 1 0 年国債	27,000,000	28,152,630	
	3 3 3 1 0 年国債	10,000,000	10,419,900	
	3 3 4 1 0 年国債	20,000,000	20,854,200	
	3 3 5 1 0 年国債	40,000,000	41,430,400	
	3 3 6 1 0 年国債	20,000,000	20,722,200	
	3 3 8 1 0 年国債	30,000,000	30,861,900	
3 3 9 1 0 年国債	30,000,000	30,875,700		
3 4 0 1 0 年国債	20,000,000	20,583,600		

	3 4 3	1 0 年国債	30,000,000	30,069,600	
	3 4 4	1 0 年国債	20,000,000	20,028,600	
	3 4 5	1 0 年国債	40,000,000	40,038,800	
	1 7	物価連動国債	50,000,000	53,843,250	
国債証券 合計				928,088,430	
地方債証券	3 4 9	大阪府公債	10,000,000	10,564,900	
	2 4 - 1 3	愛知県公債	27,000,000	28,104,921	
	2 5 - 8	福岡県公債	10,000,000	10,044,840	
	2 1 - 1 1	千葉県公債	20,000,000	20,831,500	
	2 1 - 1 2	千葉県公債	19,000,000	19,824,923	
	2 6 - 3	千葉県公債	20,000,000	20,671,000	
	1	千葉県 2 0 年	10,000,000	11,629,960	
	2 3 - 2	新潟県公債	10,000,000	10,491,920	
	2 3 - 3	堺市公債	12,000,000	12,008,280	
	2 7 - 2	熊本県公債	27,690,000	28,351,264	
	2 0 - 4	京都市公債	10,000,000	10,317,880	
	2 4 - 3	横浜市八マ債 5	10,000,000	10,023,900	
	2 4 - 4	横浜市八マ債 5	18,600,000	18,645,570	
	2 5 - 2	横浜市八マ債 5	15,000,000	15,076,290	
	2 3 - 6	札幌市公債	10,000,000	10,450,220	
	2 5 - 4	福岡市公債	15,000,000	15,576,045	
2 3 - 1	岡山市公債	9,000,000	9,430,011		
地方債証券 合計				262,043,424	
合計				1,190,131,854	

## 第 2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第 3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「財形株式マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成28年2月1日現在	平成29年2月1日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		

流動資産		
コール・ローン	58,684,511	15,308,589
株式	790,571,350	815,226,358
派生商品評価勘定	537,808	136,536
未収入金	10,424,200	-
未収配当金	998,730	1,106,600
前払金	1,789,250	-
差入委託証拠金	2,070,000	516,000
流動資産合計	865,075,849	832,294,083
資産合計	865,075,849	832,294,083
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,859,128	-
前受金	-	25,400
未払金	35,668,700	-
流動負債合計	37,527,828	25,400
負債合計	37,527,828	25,400
純資産の部		
元本等		
元本	1	644,079,603
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		183,468,418
元本等合計		827,548,021
純資産合計		832,268,683
負債純資産合計	865,075,849	832,294,083

## 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28年2月2日 至 平成29年2月1日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成28年2月1日現在	平成29年2月1日現在
1. 1 期首	平成27年2月3日	平成28年2月2日
期首元本額	675,635,593円	644,079,603円
期中追加設定元本額	52,417,268円	54,746,645円
期中一部解約元本額	83,973,258円	89,665,084円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
財形株投（一般財形50）	380,890,734円	363,677,826円
財形株投（一般財形30）	130,486,710円	120,001,145円
財形株投（年金・住宅財形30）	132,702,159円	125,482,193円
計	644,079,603円	609,161,164円
2. 期末日における受益権の総数	644,079,603口	609,161,164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28年2月2日 至 平成29年2月1日
-----	----------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所（外国の取引所）における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年2月1日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成28年2月1日現在	平成29年2月1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	25,463,501	39,372,888
合計	25,463,501	39,372,888

(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27年2月3日から平成28年2月1日まで、及び平成28年2月2日から平成29年2月1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28年2月1日 現在				平成29年2月1日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	34,886,250	-	33,580,000	1,306,250	12,110,600	-	12,248,000	137,400
合計	34,886,250	-	33,580,000	1,306,250	12,110,600	-	12,248,000	137,400

(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28年2月1日現在	平成29年2月1日現在
1口当たり純資産額	1.2849円	1.3663円
(1万口当たり純資産額)	(12,849円)	(13,663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	700	548.00	383,600	
マルハニチロ	100	3,125.00	312,500	
ショーボンドHD	100	4,865.00	486,500	
国際石油開発帝石	2,200	1,113.00	2,448,600	
安藤・間	600	799.00	479,400	
東急建設	300	898.00	269,400	
コムシスホールディングス	200	2,076.00	415,200	
大成建設	2,000	806.00	1,612,000	
大林組	1,300	1,087.00	1,413,100	
清水建設	1,000	1,046.00	1,046,000	
飛島建設	2,300	178.00	409,400	
長谷工コーポレーション	500	1,256.00	628,000	
鹿島建設	2,000	784.00	1,568,000	
鉄建建設	1,000	332.00	332,000	
西松建設	1,000	574.00	574,000	
三井住友建設	4,600	122.00	561,200	
大豊建設	1,000	526.00	526,000	
戸田建設	1,000	627.00	627,000	
熊谷組	1,000	321.00	321,000	
大東建託	200	15,920.00	3,184,000	
五洋建設	700	558.00	390,600	
住友林業	300	1,631.00	489,300	
大和ハウス	1,200	3,048.00	3,657,600	
ライト工業	300	1,232.00	369,600	
積水ハウス	1,300	1,842.50	2,395,250	
きんでん	400	1,471.00	588,400	
協和エクシオ	200	1,669.00	333,800	
九電工	100	2,999.00	299,900	
三機工業	400	980.00	392,000	
日揮	400	1,963.00	785,200	
大気社	100	2,860.00	286,000	
日比谷総合設備	200	1,705.00	341,000	
日本製粉	200	1,615.00	323,000	

日清製粉G本社	400	1,715.00	686,000
日本甜菜糖	300	2,325.00	697,500
日本M&Aセンター	200	3,325.00	665,000
エス・エム・エス	100	2,684.00	268,400
テンプホールディングス	400	2,022.00	808,800
森永製菓	100	4,985.00	498,500
江崎グリコ	100	5,290.00	529,000
山崎製パン	300	2,295.00	688,500
カルビー	200	3,535.00	707,000
森永乳業	1,000	792.00	792,000
ヤクルト	200	6,070.00	1,214,000
明治ホールディングス	200	8,820.00	1,764,000
雪印メグミルク	100	2,973.00	297,300
丸大食品	1,000	492.00	492,000
伊藤ハム米久HLDGS	300	1,015.00	304,500
総合警備保障	200	4,110.00	822,000
カカクコム	400	1,993.00	797,200
エムスリー	400	3,035.00	1,214,000
ディー・エヌ・エー	200	2,364.00	472,800
博報堂DYHLDGS	600	1,397.00	838,200
サッポロホールディングス	100	2,935.00	293,500
アサヒグループホールディング	700	3,972.00	2,780,400
キリンHD	1,800	1,865.50	3,357,900
宝ホールディングス	300	1,045.00	313,500
オエノンホールディングス	2,000	270.00	540,000
コカ・コーラウエスト	200	3,300.00	660,000
コカ・コーライーストジャパン	200	2,475.00	495,000
サントリー食品インター	300	4,820.00	1,446,000
伊藤園	100	3,800.00	380,000
キーコーヒー	200	2,109.00	421,800
日清オイリオグループ	1,000	538.00	538,000
J-オイルミルズ	100	4,040.00	404,000
ローソン	100	8,250.00	825,000
カワチ薬品	100	2,962.00	296,200
エービーシー・マート	100	6,570.00	657,000
双日	2,200	291.00	640,200
アルフレッサホールディングス	400	1,855.00	742,000
味の素	800	2,305.00	1,844,000
キューピー	200	2,866.00	573,200
ハウス食品G本社	200	2,474.00	494,800



カゴメ	200	2,934.00	586,800
アリアケジャパン	100	5,900.00	590,000
ニチレイ	200	2,327.00	465,400
横浜冷凍	400	1,036.00	414,400
東洋水産	200	4,045.00	809,000
日清食品HD	200	6,020.00	1,204,000
日本たばこ産業	2,200	3,631.00	7,988,200
ユーグレナ	200	1,180.00	236,000
ゲンゼ	1,000	392.00	392,000
ヒューリック	800	1,109.00	887,200
MonotaRO	200	3,075.00	615,000
あいホールディングス	100	2,133.00	213,300
J.フロントリテイリング	500	1,654.00	827,000
ドトール・日レスHD	100	2,179.00	217,900
マツモトキヨシHLDGS	100	5,570.00	557,000
スタートトゥデイ	400	2,500.00	1,000,000
三越伊勢丹HD	800	1,343.00	1,074,400
東洋紡	2,000	186.00	372,000
倉敷紡績	2,000	233.00	466,000
ダイワボウHD	2,000	286.00	572,000
シキボウ	5,000	155.00	775,000
トヨタ紡織	200	2,547.00	509,400
バイタルKSKHD	300	1,024.00	307,200
日本毛織	500	903.00	451,500
野村不動産HLDGS	300	1,953.00	585,900
東急不動産HD	900	660.00	594,000
飯田GHD	300	2,119.00	635,700
セブン&アイ・HLDGS	1,500	4,558.00	6,837,000
ツルハホールディングス	100	10,640.00	1,064,000
帝人	300	2,417.00	725,100
東レ	3,000	988.70	2,966,100
クラレ	600	1,809.00	1,085,400
旭化成	2,000	1,052.00	2,104,000
SUMCO	400	1,780.00	712,000
コメダホールディングス	200	1,877.00	375,400
クスリのアオキHLDGS	100	4,735.00	473,500
セーレン	200	1,415.00	283,000
ホギメディカル	100	7,050.00	705,000
TIS	200	2,547.00	509,400
ネクソン	500	1,750.00	875,000

特種東海製紙	100	4,025.00	402,500
ガンホー・オンライン・エンター	1,500	244.00	366,000
GMOペイメントゲートウェイ	100	5,930.00	593,000
王子ホールディングス	1,000	505.00	505,000
日本製紙	100	2,070.00	207,000
L I N E	100	3,615.00	361,500
レンゴー	600	693.00	415,800
ザ・パック	100	2,968.00	296,800
昭和電工	300	1,866.00	559,800
住友化学	3,000	605.00	1,815,000
日産化学	200	4,100.00	820,000
クレハ	100	4,810.00	481,000
東ソー	1,000	865.00	865,000
トクヤマ	1,000	543.00	543,000
セントラル硝子	1,000	552.00	552,000
東亜合成	300	1,216.00	364,800
大阪ソーダ	1,000	498.00	498,000
デンカ	1,000	559.00	559,000
イビデン	300	1,556.00	466,800
信越化学	700	9,766.00	6,836,200
エア・ウォーター	300	2,092.00	627,600
大陽日酸	300	1,346.00	403,800
日本パ - カライジング	200	1,411.00	282,200
日本触媒	100	7,820.00	782,000
大日精化	1,000	698.00	698,000
カネカ	1,000	983.00	983,000
協和発酵キリン	500	1,581.00	790,500
三菱瓦斯化学	400	2,183.00	873,200
三井化学	2,000	544.00	1,088,000
J S R	400	1,981.00	792,400
東京応化工業	100	3,990.00	399,000
三菱ケミカルH L D G S	2,500	798.80	1,997,000
ダイセル	600	1,258.00	754,800
住友ベ - クライト	1,000	665.00	665,000
積水化学	800	1,886.00	1,508,800
宇部興産	2,000	274.00	548,000
積水樹脂	200	1,803.00	360,600
日立化成	200	3,240.00	648,000
野村総合研究所	200	3,860.00	772,000
ケネディクス	1,100	420.00	462,000

電通	400	5,210.00	2,084,000
A D E K A	200	1,645.00	329,000
花 王	1,000	5,624.00	5,624,000
武田薬品	1,300	4,768.00	6,198,400
アステラス製薬	3,800	1,465.00	5,567,000
大日本住友製薬	300	1,907.00	572,100
塩野義製薬	500	5,443.00	2,721,500
田辺三菱製薬	500	2,281.00	1,140,500
日本新薬	100	5,460.00	546,000
中外製薬	400	3,405.00	1,362,000
科研製薬	100	5,730.00	573,000
エーザイ	500	6,228.00	3,114,000
ロート製薬	200	1,973.00	394,600
小野薬品	1,000	2,354.50	2,354,500
久光製薬	100	5,930.00	593,000
参天製薬	700	1,447.00	1,012,900
ツムラ	200	3,275.00	655,000
日医工	200	1,619.00	323,800
テ ル モ	600	4,130.00	2,478,000
みらかホールディングス	100	5,250.00	525,000
沢井製薬	100	5,840.00	584,000
第一三共	1,100	2,560.50	2,816,550
大塚ホールディングス	800	5,236.00	4,188,800
大正製薬HD	100	9,610.00	961,000
ペプチドリーム	100	5,680.00	568,000
日本ペイントHOLD	300	3,330.00	999,000
関西ペイント	400	2,346.00	938,400
中国塗料	500	818.00	409,000
太陽ホールディングス	100	4,650.00	465,000
D I C	200	3,535.00	707,000
オリエンタルランド	400	6,208.00	2,483,200
ダスキン	200	2,521.00	504,200
パーク24	200	3,100.00	620,000
明光ネットワークジャパン	400	1,253.00	501,200
フジ・メディア・HD	400	1,641.00	656,400
ラウンドワン	400	824.00	329,600
リゾートトラスト	200	2,081.00	416,200
オービック	100	5,340.00	534,000
ヤフー	3,100	472.00	1,463,200
ビー・エム・エル	100	2,748.00	274,800

トレンドマイクロ	200	4,410.00	882,000	
日本オラクル	100	6,380.00	638,000	
ユー・エス・エス	500	1,987.00	993,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	100	3,110.00	311,000	
サイバーエージェント	200	2,889.00	577,800	
楽天	2,000	1,106.00	2,212,000	
大塚商会	100	5,810.00	581,000	
デジタルガレージ	200	2,073.00	414,600	
富士フイルムＨＬＤＧＳ	800	4,161.00	3,328,800	
コニカミノルタ	900	1,074.00	966,600	
資生堂	700	3,168.00	2,217,600	
ライオン	1,000	1,994.00	1,994,000	
高砂香料	100	3,015.00	301,500	
マンダム	100	5,340.00	534,000	
ミルボン	100	4,975.00	497,500	
コーセー	100	9,460.00	946,000	
コニシ	300	1,347.00	404,100	
長谷川香料	200	1,989.00	397,800	
小林製薬	100	5,080.00	508,000	
アース製薬	100	4,870.00	487,000	
昭和シェル石油	400	1,106.00	442,400	
東燃ゼネラル石油	1,000	1,333.00	1,333,000	
出光興産	200	3,580.00	716,000	
JXホールディングス	3,700	531.90	1,968,030	
コスモエネルギーＨＬＤＧＳ	200	1,929.00	385,800	
横浜ゴム	300	1,991.00	597,300	
東洋ゴム	200	1,346.00	269,200	
ブリヂストン	1,300	4,153.00	5,398,900	
住友ゴム	400	1,777.00	710,800	
バンドー化学	500	1,006.00	503,000	
旭硝子	2,000	845.00	1,690,000	
日本電気硝子	1,000	656.00	656,000	
住友大阪セメント	1,000	456.00	456,000	
太平洋セメント	3,000	398.00	1,194,000	
TOTO	300	4,345.00	1,303,500	
日本碍子	500	2,330.00	1,165,000	
日本特殊陶業	400	2,566.00	1,026,400	
新日鐵住金	1,700	2,794.50	4,750,650	
神戸製鋼所	800	1,117.00	893,600	
JFEホールディングス	1,000	2,066.50	2,066,500	

大和工業	100	3,305.00	330,500
淀川製鋼所	100	3,310.00	331,000
丸一鋼管	100	3,845.00	384,500
大同特殊鋼	1,000	579.00	579,000
山陽特殊製鋼	1,000	626.00	626,000
日立金属	400	1,582.00	632,800
大平洋金属	1,000	358.00	358,000
日本製鋼所	200	2,136.00	427,200
日本軽金属HD	1,200	278.00	333,600
三井金属	1,000	315.00	315,000
三菱マテリアル	300	3,875.00	1,162,500
住友鉱山	1,000	1,552.00	1,552,000
DOWAホールディングス	1,000	963.00	963,000
古河電工	100	3,850.00	385,000
住友電工	1,500	1,670.00	2,505,000
フジクラ	600	720.00	432,000
アサヒHD	200	2,275.00	455,000
東洋製罐グループHD	200	2,101.00	420,200
三和ホールディングス	400	1,057.00	422,800
文化シヤツタ -	300	908.00	272,400
三協立山	200	1,754.00	350,800
LIXILグループ	600	2,651.00	1,590,600
リンナイ	100	9,630.00	963,000
ユニプレス	200	2,412.00	482,400
東プレ	100	2,876.00	287,600
日本発条	400	1,149.00	459,600
三浦工業	200	1,802.00	360,400
テクノプロ・ホールディング	100	3,935.00	393,500
リクルートホールディングス	800	5,120.00	4,096,000
東芝機械	1,000	499.00	499,000
アマダホールディングス	500	1,335.00	667,500
アイダエンジニア	300	1,117.00	335,100
オーエスジー	200	2,373.00	474,600
旭ダイヤモンド	500	851.00	425,500
DMG森精機	300	1,550.00	465,000
ソディック	400	1,003.00	401,200
ディスコ	100	14,280.00	1,428,000
日本郵政	800	1,418.00	1,134,400
豊田自動織機	300	5,470.00	1,641,000
ナブテスコ	200	2,954.00	590,800

S M C	100	31,410.00	3,141,000	
オイレス工業	200	2,035.00	407,000	
小松製作所	1,800	2,775.00	4,995,000	
住友重機械	1,000	801.00	801,000	
日立建機	200	2,638.00	527,600	
井関農機	1,000	226.00	226,000	
クボタ	1,700	1,824.50	3,101,650	
月島機械	400	1,266.00	506,400	
新東工業	400	1,028.00	411,200	
荏原製作所	200	3,500.00	700,000	
ダイキン工業	500	11,340.00	5,670,000	
栗田工業	200	2,687.00	537,400	
アネスト岩田	300	1,108.00	332,400	
ダイフク	300	2,523.00	756,900	
タダノ	200	1,444.00	288,800	
S A N K Y O	100	3,800.00	380,000	
福島工業	100	3,590.00	359,000	
ア マ ノ	200	2,192.00	438,400	
ブラザー工業	600	2,121.00	1,272,600	
モリタホールディングス	300	1,626.00	487,800	
グローリー	200	3,510.00	702,000	
セガサミーホールディングス	400	1,788.00	715,200	
ホシザキ	100	9,240.00	924,000	
日本精工	800	1,429.00	1,143,200	
N T N	1,000	516.00	516,000	
ジェイテクト	400	1,904.00	761,600	
ミネベアミツミ	936	1,143.00	1,069,848	
T H K	300	2,814.00	844,200	
日 立	9,000	648.20	5,833,800	
東 芝	8,000	244.30	1,954,400	
三菱電機	3,800	1,742.50	6,621,500	
富士電機	1,000	674.00	674,000	
安川電機	400	2,063.00	825,200	
マキタ	200	7,530.00	1,506,000	
マブチモーター	100	5,870.00	587,000	
日本電産	500	10,770.00	5,385,000	
J V C ケンウッド	1,200	301.00	361,200	
オムロン	400	4,935.00	1,974,000	
日東工業	300	1,548.00	464,400	
ジーエス・ユアサ コーポ	1,000	466.00	466,000	

日本電気	5,000	267.00	1,335,000
富士通	4,000	686.80	2,747,200
沖電気	200	1,653.00	330,600
セイコーエプソン	600	2,409.00	1,445,400
EIZO	100	3,195.00	319,500
パナソニック	4,100	1,185.00	4,858,500
日立国際電気	200	2,541.00	508,200
ソニー	2,500	3,410.00	8,525,000
TDK	200	8,190.00	1,638,000
アルプス電気	400	3,135.00	1,254,000
フオスタ - 電機	200	1,755.00	351,000
ヒロセ電機	100	14,820.00	1,482,000
横河電機	400	1,805.00	722,000
アズビル	100	3,405.00	340,500
日本光電工業	200	2,568.00	513,600
堀場製作所	100	5,930.00	593,000
アドバンテスト	300	2,126.00	637,800
キーエンス	200	43,860.00	8,772,000
シスメックス	300	6,840.00	2,052,000
日本マイクロニクス	200	1,106.00	221,200
デンソー	900	4,959.00	4,463,100
オプテックスグループ	100	2,655.00	265,500
スタンレー電気	300	3,185.00	955,500
ウシオ電機	300	1,448.00	434,400
カシオ	400	1,563.00	625,200
ファナック	400	22,155.00	8,862,000
ローム	200	7,280.00	1,456,000
浜松ホトニクス	300	3,295.00	988,500
京セラ	600	6,095.00	3,657,000
太陽誘電	200	1,351.00	270,200
村田製作所	400	14,640.00	5,856,000
双葉電子工業	200	1,978.00	395,600
日東電工	300	9,450.00	2,835,000
東海理化電機	200	2,276.00	455,200
ニチコン	400	1,069.00	427,600
三井造船	2,000	182.00	364,000
日立造船	700	597.00	417,900
三菱重工業	6,000	509.00	3,054,000
川崎重工業	3,000	351.00	1,053,000
IHI	3,000	305.00	915,000

名村造船所	400	757.00	302,800
全国保証	100	3,895.00	389,500
めぶきフィナンシャルG	1,900	440.00	836,000
九州フィナンシャルG	700	786.00	550,200
かんぼ生命保険	100	2,597.00	259,700
ゆうちょ銀行	1,000	1,373.00	1,373,000
コンコルディア・フィナンシャル	2,500	598.90	1,497,250
西日本フィナンシャルHD	300	1,191.00	357,300
日産自動車	4,200	1,112.00	4,670,400
いすゞ自動車	1,100	1,541.00	1,695,100
トヨタ自動車	4,400	6,546.00	28,802,400
日野自動車	600	1,285.00	771,000
三菱自動車工業	1,500	689.00	1,033,500
武蔵精密工業	100	3,140.00	314,000
極東開発工業	400	1,707.00	682,800
タチエス	200	1,862.00	372,400
N O K	200	2,333.00	466,600
K Y B	1,000	557.00	557,000
太平洋工業	300	1,413.00	423,900
アイシン精機	400	5,180.00	2,072,000
マ ッ ダ	1,200	1,639.00	1,966,800
本田技研	3,200	3,415.00	10,928,000
スズキ	700	4,456.00	3,119,200
富士重工業	1,100	4,470.00	4,917,000
ヤマハ発動機	500	2,366.00	1,183,000
小糸製作所	200	5,960.00	1,192,000
豊田合成	200	2,750.00	550,000
シマノ	100	17,780.00	1,778,000
テイ・エス テック	100	2,751.00	275,100
良品計画	100	21,300.00	2,130,000
第一興商	100	4,460.00	446,000
メディパルHD	400	1,813.00	725,200
アズワン	100	5,220.00	522,000
コーナン商事	200	2,109.00	421,800
ネットワンシステムズ	500	778.00	389,000
ドンキホーテホールディング	300	4,150.00	1,245,000
ゼンショーホールディングス	200	1,950.00	390,000
ハイデイ日高	100	2,705.00	270,500
コロワイド	200	1,904.00	380,800
壱番屋	100	3,760.00	376,000



スギホールディングス	100	5,270.00	527,000	
東京精密	100	3,700.00	370,000	
マニー	100	2,730.00	273,000	
ニコン	600	1,826.00	1,095,600	
トプコン	300	1,839.00	551,700	
オリンパス	600	3,905.00	2,343,000	
S C R E E Nホールディングス	100	7,150.00	715,000	
H O Y A	800	4,881.00	3,904,800	
キヤノン	1,900	3,292.00	6,254,800	
リ コ ー	1,200	932.00	1,118,400	
シチズン時計	600	708.00	424,800	
パラマウントベッドHD	100	4,675.00	467,500	
バンダイナムコHLDGS	400	3,175.00	1,270,000	
パイロットコーポレーション	100	4,575.00	457,500	
タカラトミー	300	1,227.00	368,100	
凸版印刷	1,000	1,104.00	1,104,000	
大日本印刷	1,000	1,154.00	1,154,000	
日本写真印刷	100	3,125.00	312,500	
藤森工業	200	2,960.00	592,000	
アシックス	400	2,150.00	860,000	
ヤマハ	300	3,450.00	1,035,000	
ピジヨン	200	3,140.00	628,000	
任 天 堂	200	22,625.00	4,525,000	
コ ク ヨ	200	1,387.00	277,400	
ニ フ コ	100	5,770.00	577,000	
日本バルカー	200	1,825.00	365,000	
伊 藤 忠	2,600	1,552.50	4,036,500	
丸 紅	3,500	684.90	2,397,150	
豊田通商	300	3,100.00	930,000	
兼 松	2,000	197.00	394,000	
美 津 濃	1,000	589.00	589,000	
ユニー・ファミリーマートHD	200	7,250.00	1,450,000	
三井物産	3,100	1,659.00	5,142,900	
東京エレクトロン	200	11,550.00	2,310,000	
日立ハイテクノロジーズ	100	4,915.00	491,500	
スターゼン	100	4,845.00	484,500	
山 善	400	976.00	390,400	
住友商事	2,000	1,422.50	2,845,000	
日本ユニシス	200	1,453.00	290,600	
三菱商事	2,700	2,573.00	6,947,100	

ユアサ商事	200	3,105.00	621,000
神鋼商事	200	2,458.00	491,600
阪和興業	1,000	769.00	769,000
ニプロ	300	1,272.00	381,600
岩谷産業	1,000	633.00	633,000
昭光通商	5,000	102.00	510,000
兼松エレクトロニクス	200	2,584.00	516,800
三愛石油	400	873.00	349,200
稲畑産業	300	1,326.00	397,800
ユニ・チャーム	800	2,564.50	2,051,600
ヤマトインタ・ナショナル	1,200	409.00	490,800
東邦ホールディングス	100	2,424.00	242,400
サンゲツ	200	1,993.00	398,600
リョーサン	100	3,535.00	353,500
モスフード サービス	100	3,350.00	335,000
木曽路	200	2,374.00	474,800
ロイヤルホールディングス	200	1,926.00	385,200
島 忠	100	2,757.00	275,700
リンガーハット	200	2,354.00	470,800
コメリ	100	2,561.00	256,100
青山商事	100	3,975.00	397,500
高 島 屋	1,000	974.00	974,000
エイチ・ツー・オーリテイリング	200	1,883.00	376,600
丸井グループ	400	1,645.00	658,000
クレディセゾン	300	2,067.00	620,100
イオン	1,400	1,643.00	2,300,200
イ ズ ミ	100	4,855.00	485,500
平 和 堂	100	2,672.00	267,200
フ ジ	100	2,382.00	238,200
ケーズホールディングス	200	2,040.00	408,000
新生銀行	4,000	199.00	796,000
あおぞら銀行	2,000	410.00	820,000
三菱UFJフィナンシャルG	26,600	727.40	19,348,840
りそなホールディングス	4,300	588.40	2,530,120
三井住友トラストHD	700	4,167.00	2,916,900
三井住友フィナンシャルG	2,900	4,413.00	12,797,700
北越銀行	200	2,704.00	540,800
千葉銀行	1,000	744.00	744,000
群馬銀行	700	626.00	438,200
武蔵野銀行	100	3,375.00	337,500

山形銀行	1,000	494.00	494,000
岩手銀行	100	4,590.00	459,000
ふくおかフィナンシャルG	1,000	505.00	505,000
静岡銀行	1,000	994.00	994,000
スルガ銀行	400	2,631.00	1,052,400
大垣共立銀行	1,000	443.00	443,000
福井銀行	1,000	296.00	296,000
北國銀行	1,000	433.00	433,000
南都銀行	100	4,565.00	456,500
京都銀行	1,000	906.00	906,000
紀陽銀行	200	1,827.00	365,400
ほくほくフィナンシャルG	200	1,958.00	391,600
広島銀行	1,000	537.00	537,000
山陰合同銀行	400	961.00	384,400
中国銀行	200	1,687.00	337,400
百十四銀行	1,000	386.00	386,000
大分銀行	1,000	427.00	427,000
佐賀銀行	2,000	291.00	582,000
十八銀行	1,000	350.00	350,000
沖縄銀行	100	4,090.00	409,000
琉球銀行	400	1,559.00	623,600
セブン銀行	1,400	326.00	456,400
みずほフィナンシャルG	46,700	208.70	9,746,290
SBIホールディングス	400	1,574.00	629,600
日本証券金融	900	619.00	557,100
名古屋銀行	100	4,150.00	415,000
栃木銀行	900	585.00	526,500
イオンフィナンシャルサービス	300	2,016.00	604,800
アコム	1,000	476.00	476,000
日立キャピタル	100	2,914.00	291,400
オリックス	2,500	1,722.00	4,305,000
三菱UFJリース	1,200	601.00	721,200
トモニホールディングス	700	609.00	426,300
大和証券G本社	3,000	719.70	2,159,100
野村ホールディングス	7,400	721.20	5,336,880
丸三証券	400	956.00	382,400
東海東京HD	600	632.00	379,200
いちよし証券	600	883.00	529,800
SOMPOホールディングス	700	4,101.00	2,870,700
日本取引所グループ	1,100	1,667.00	1,833,700

マネックスG	1,300	304.00	395,200
フィデアホール	2,200	206.00	453,200
MS & AD	1,000	3,811.00	3,811,000
SONY FH	400	1,865.00	746,000
第一生命HLDGS	2,200	2,066.50	4,546,300
東京海上HD	1,400	4,730.00	6,622,000
T & Dホールディングス	1,300	1,697.50	2,206,750
三井不動産	2,000	2,612.50	5,225,000
三菱地所	3,000	2,159.50	6,478,500
平和不動産	200	1,534.00	306,800
東京建物	400	1,488.00	595,200
住友不動産	1,000	3,050.00	3,050,000
テーオーシー	300	916.00	274,800
レオパレス21	500	649.00	324,500
イオンモール	300	1,647.00	494,100
東武鉄道	2,000	575.00	1,150,000
相鉄ホールディングス	1,000	571.00	571,000
東京急行	2,000	830.00	1,660,000
京浜急行	1,000	1,322.00	1,322,000
小田急電鉄	600	2,240.00	1,344,000
京王電鉄	1,000	929.00	929,000
京成電鉄	300	2,666.00	799,800
東日本旅客鉄道	700	10,320.00	7,224,000
西日本旅客鉄道	300	7,374.00	2,212,200
東海旅客鉄道	300	18,505.00	5,551,500
西武ホールディングス	500	1,884.00	942,000
西日本鉄道	1,000	498.00	498,000
近鉄グループHLDGS	3,000	435.00	1,305,000
阪急阪神HLDGS	500	3,840.00	1,920,000
南海電鉄	1,000	559.00	559,000
京阪ホールディングス	1,000	755.00	755,000
神戸電鉄	2,000	385.00	770,000
名古屋鉄道	1,000	558.00	558,000
山陽電鉄	1,000	611.00	611,000
日本通運	1,000	584.00	584,000
ヤマトホールディングス	700	2,310.00	1,617,000
山九	1,000	726.00	726,000
センコー	400	739.00	295,600
ニッコンホールディングス	100	2,332.00	233,200
セイノーホールディングス	300	1,279.00	383,700

日本郵船	3,000	245.00	735,000
商船三井	2,000	352.00	704,000
川崎汽船	1,000	276.00	276,000
飯野海運	1,000	464.00	464,000
九州旅客鉄道	300	3,065.00	919,500
日本航空	600	3,638.00	2,182,800
A N Aホールディングス	6,000	340.00	2,040,000
三井倉庫H O L D	1,000	339.00	339,000
東京放送H D	300	1,983.00	594,900
日本テレビH L D S	400	2,075.00	830,000
テレビ朝日H D	100	2,239.00	223,900
日本電信電話	2,800	4,958.00	13,882,400
K D D I	3,400	3,036.00	10,322,400
光通信	100	10,350.00	1,035,000
N T T ドコモ	2,600	2,717.00	7,064,200
G M Oインターネット	200	1,640.00	328,000
東京電力H D	3,300	439.00	1,448,700
中部電力	1,100	1,514.00	1,665,400
関西電力	1,500	1,228.00	1,842,000
中国電力	400	1,256.00	502,400
北陸電力	300	1,144.00	343,200
東北電力	800	1,414.00	1,131,200
四国電力	400	1,105.00	442,000
九州電力	900	1,249.00	1,124,100
北海道電力	500	810.00	405,000
沖縄電力	100	2,526.00	252,600
電源開発	300	2,773.00	831,900
東京瓦斯	4,000	501.30	2,005,200
大阪瓦斯	3,000	434.30	1,302,900
東邦瓦斯	1,000	841.00	841,000
西部瓦斯	1,000	254.00	254,000
静岡ガス	400	742.00	296,800
東 宝	200	3,250.00	650,000
N T T データ	200	5,620.00	1,124,000
共立メンテナンス	100	7,560.00	756,000
イチネンホールディングス	500	1,128.00	564,000
アインホールディングス	100	8,230.00	823,000
東京ドーム	400	1,067.00	426,800
D T S	200	2,569.00	513,800
スクウェア・エニックス・H D	200	3,225.00	645,000

カプコン	100	2,411.00	241,100	
日本空港ビルデング	100	4,050.00	405,000	
乃村工藝社	200	1,951.00	390,200	
S C S K	100	4,210.00	421,000	
セコム	400	8,180.00	3,272,000	
富士ソフト	100	2,780.00	278,000	
船井総研ホールディング	200	1,768.00	353,600	
N S D	300	1,785.00	535,500	
コナミホールディングス	200	4,640.00	928,000	
ベネッセホールディングス	200	3,275.00	655,000	
ダイセキ	200	2,270.00	454,000	
トラスコ中山	200	2,560.00	512,000	
ヤマダ電機	1,200	624.00	748,800	
オートバックスセブン	200	1,808.00	361,600	
アークランドサカモト	300	1,373.00	411,900	
ニトリホールディングス	200	12,800.00	2,560,000	
吉野家ホールディングス	200	1,643.00	328,600	
イエローハット	200	2,767.00	553,400	
王将フードサービス	100	4,385.00	438,500	
アークス	100	2,569.00	256,900	
パローホールディングス	100	2,985.00	298,500	
ミスミグループ本社	400	2,069.00	827,600	
ファーストリテイリング	100	35,920.00	3,592,000	
ソフトバンクグループ	1,600	8,805.00	14,088,000	
スズケン	200	3,755.00	751,000	
サンドラッグ	100	7,810.00	781,000	
合計			815,226,358	

## (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29年2月28日

資産総額	557,400,906円
負債総額	876,731円
純資産総額（ - ）	556,524,175円
発行済数量	557,750,820口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9978円

## (参考) 財形公社債マザーファンド

## 純資産額計算書

平成29年2月28日

資産総額	1,238,675,772円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	1,238,675,772円
発行済数量	930,942,666口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3306円

## (参考) 財形株式マザーファンド

## 純資産額計算書

平成29年2月28日

資産総額	835,362,205円
負債総額	1,184,008円
純資産総額（ - ）	834,178,197円
発行済数量	607,001,075口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3743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。

## 第二部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成29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年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役は、株主総会において選任され、その任期は選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結のときまでです。

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成29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	73	225,408
追加型株式投資信託	683	13,096,201
株式投資信託 合計	756	13,321,609
単位型公社債投資信託	15	102,779
追加型公社債投資信託	14	2,158,039
公社債投資信託 合計	29	2,260,819
総合計	785	15,582,427

## 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8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第57期事業年度（平成27年4月1日から平成28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58期事業年度に係る中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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、百万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:百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,438	31,715
有価証券	4,878	1,137
前払費用	139	159
未収委託者報酬	10,295	9,896
未収収益	110	87
繰延税金資産	585	468
その他	153	83
流動資産計	47,600	43,547
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物	255	243
器具備品	21	18
器具備品	234	224
無形固定資産	2,759	2,706
ソフトウェア	2,758	2,385
ソフトウェア仮勘定	1	321

投資その他の資産	12,979	14,223
投資有価証券	6,667	7,872
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	124	123
長期差入保証金	996	1,049
その他	60	47
固定資産計	15,995	17,173
資産合計	63,596	60,720

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	64	61
未払金	9,172	8,789
未払収益分配金	5	5
未払償還金	72	63
未払手数料	4,965	4,330
その他未払金	2	2
未払費用	4,162	4,215
未払法人税等	1,133	1,155
未払消費税等	1,429	538
賞与引当金	1,092	937
その他	747	22
流動負債計	17,801	15,720
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,072	2,209
役員退職慰労引当金	101	93
繰延税金負債	1,745	1,410
その他	2	-
固定負債計	3,920	3,714
負債合計	21,722	19,435
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		

資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	14,126	13,960
利益剰余金合計	14,501	14,334
株主資本合計	41,171	41,004
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	702	280
評価・換算差額等合計	702	280
純資産合計	41,873	41,284
負債・純資産合計	63,596	60,720

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	90,924	88,850
その他営業収益	933	799
営業収益計	91,858	89,650
営業費用		
支払手数料	49,978	46,165
広告宣伝費	670	646
調査費	9,013	10,116
調査費	867	925
委託調査費	8,146	9,191
委託計算費	756	761
営業雑経費	1,289	1,346
通信費	252	249
印刷費	481	515
協会費	53	53
諸会費	13	14
その他営業雑経費	488	513
営業費用計	61,709	59,036
一般管理費		
給料	5,881	5,797

役員報酬	289	354
給料・手当	3,803	3,850
賞与	695	654
賞与引当金繰入額	1,092	937
福利厚生費	831	837
交際費	45	70
旅費交通費	176	211
租税公課	259	325
不動産賃借料	1,180	1,258
退職給付費用	383	394
役員退職慰労引当金繰入額	38	37
固定資産減価償却費	1,032	1,110
諸経費	1,372	1,486
一般管理費計	11,201	11,531
営業利益	18,948	19,082

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	1,226	1	109
受取利息		20		25
投資有価証券売却益		145		115
外国税関連費用引当金戻入益		-		171
その他		226		73
営業外収益計		1,620		496
営業外費用				
投資有価証券売却損		84		14
その他		67		94
営業外費用計		152		108
経常利益		20,416		19,471
特別利益				
固定資産売却益		7		-
特別利益計		7		-
特別損失				
外国税関連費用		746		-
その他		26		-
特別損失計		772		-
税引前当期純利益		19,651		19,471
法人税、住民税及び事業税		6,238		6,215

法人税等調整額	17	6
法人税等合計	6,220	6,209
当期純利益	13,431	13,262

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△10,126	△10,126	△10,126
当期純利益	-	-	-	13,431	13,431	13,431
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,304	3,304	3,304
当期末残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	494	494	38,360
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△10,126
当期純利益	-	-	13,431
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	208	208	208
当期変動額合計	208	208	3,513
当期末残高	702	702	41,873

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）



	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,428	△13,428	△13,428
当期純利益	-	-	-	13,262	13,262	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△166	△166	△166
当期末残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	702	702	41,873
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△13,428
当期純利益	-	-	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△422	△422	△422
当期変動額合計	△422	△422	△589
当期末残高	280	280	41,284

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (表示方法の変更)

### (損益計算書)

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた372百万円は、「投資有価証券売却益」145百万円、「その他」226百万円として組替えております。

## (貸借対照表関係)

### 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	20百万円	23百万円
器具備品	275百万円	232百万円

## 2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
未払金	4,084百万円	4,320百万円

## 3 保証債務

前事業年度（平成27年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,834百万円に対して保証を行っております。

当事業年度（平成28年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,749百万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次のものがあります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
受取配当金	1,065百万円	-

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27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26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26年 6月26日
----------------------	------	--------	-------	----------------	----------------

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

平成27年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	13,428百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,148円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月24日

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28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27年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,428	5,148	平成27年 3月31日	平成27年 6月24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28年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	13,262百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,084円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24日

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は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。

未払手数料は証券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。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## ( ) 為替変動リスクの管理

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

## ( ) 価格変動リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注2）参照のこと）。

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	31,438	31,438	-
(2) 未収委託者報酬	10,295	10,295	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	10,520	10,520	-
資産計	52,254	52,254	-
(1) 未払手数料	4,965	4,965	-
(2) その他未払金	4,127	4,127	-
(3) 未払費用(*)	3,366	3,366	-
負債計	12,460	12,460	-

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	31,715	31,715	-
(2) 未収委託者報酬	9,896	9,896	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	7,987	7,987	-
資産計	49,599	49,599	-
(1) 未払手数料	4,330	4,330	-
(2) その他未払金	4,390	4,390	-
(3) 未払費用(*)	3,420	3,420	-
負債計	12,141	12,141	-

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
(1) 其他有価証券 非上場株式	1,025	1,021
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	996	1,049

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27年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,438	-	-	-
未収委託者報酬	10,295	-	-	-
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	6	1,591	3,790	84
合計	41,740	1,591	3,790	84

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,715	-	-	-
未収委託者報酬	9,896	-	-	-
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	1,115	4,570	1,712	141
合計	42,727	4,570	1,712	141

（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27年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,129百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度（平成28年3月31日）

子会社株式（貸借対照表計上額 5,129百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	164	55	109
（2）その他 証券投資信託	4,576	3,633	943
小計	4,741	3,688	1,052
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			

その他 証券投資信託	5,779	5,793	14
小計	5,779	5,793	14
合計	10,520	9,482	1,038

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 1,025百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（平成28年3月31日）

	貸借対照表計上額 （百万円）	取得原価 （百万円）	差額 （百万円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	141	55	86
（2）その他 証券投資信託	3,875	3,408	466
小計	4,016	3,463	553
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他			
証券投資信託	3,970	4,119	148
小計	3,970	4,119	148
合計	7,987	7,583	404

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 1,021百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3．売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（1）株式	32	-	1
（2）その他 証券投資信託	34,371	145	84
合計	34,404	145	85

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	売却額 （百万円）	売却益の合計額 （百万円）	売却損の合計額 （百万円）
（1）株式	3	-	0
（2）その他 証券投資信託	19,069	115	13
合計	19,072	115	14

### 4．減損処理を行った有価証券



前事業年度において、子会社株式について11百万円の減損処理を行っております。  
当事業年度において、証券投資信託について4百万円の減損処理を行っております。

## (退職給付関係)

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

### 2. 確定給付制度

#### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,959百万円	2,072百万円
勤務費用	212	222
退職給付の支払額	118	120
その他	18	35
退職給付債務の期末残高	2,072	2,209

#### (2)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金の調整表

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,072百万円	2,209百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,072	2,209
退職給付引当金	2,072	2,209
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,072	2,209

#### (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
勤務費用	212百万円	222百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	212	222

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度170百万円、当事業年度172百万円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>繰延税金資産</b>		
退職給付引当金	670	676
賞与引当金	305	225
外国税関連費用	241	-
未払事業税	231	224
連結法人間取引(譲渡損)	128	121
投資有価証券評価損	105	95
出資金評価損	103	98
その他	206	173
繰延税金資産小計	1,992	1,615
評価性引当額	613	347
繰延税金資産合計	1,379	1,268
<b>繰延税金負債</b>		
連結法人間取引(譲渡益)	2,203	2,086
その他有価証券評価差額金	335	124
繰延税金負債合計	2,539	2,210
繰延税金負債の純額	1,159	941

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
法定実効税率	35.64%	33.06%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.14%	0.77%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.02%	0.02%
評価性引当額の増減額	2.67%	1.29%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.51%	0.19%
その他	0.07%	0.43%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.65%	31.89%

### 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

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等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32.34%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29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30.86%に、平成30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30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が24百万円、繰延税金負債（長期）が74百万円、法人税等調整額が50百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が6百万円増加しております。

（セグメント情報等）

#### [セグメント情報]

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

#### [関連情報]

##### 1. サービスごとの情報

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

##### 2. 地域ごとの情報

###### （1）営業収益

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

###### （2）有形固定資産

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

##### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

#### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）  
該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）  
該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

## （ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,834	-	-

## 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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,749	-	-

## 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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料 (注2)	28,838	未払手数料	3,751
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	685	未払費用	348
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	978	長期差入保証金	971

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	27,062	未払手数料	3,188
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	593	未払費用	252
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,028	長期差入保証金	1,027

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

### （1株当たり情報）

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,052.69円	1株当たり純資産額	15,826.85円
1株当たり当期純利益	5,148.94円	1株当たり当期純利益	5,084.10円

(注1)潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益(百万円)	13,431	13,262
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。

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (平成28年9月30日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金・預金		22,153
有価証券		529
未収委託者報酬		9,521
繰延税金資産		428
その他		351
流動資産合計		32,984
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	241
<b>無形固定資産</b>		
ソフトウェア		2,212
その他		252
無形固定資産合計		2,465
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		7,003
関係会社株式		5,129
その他		1,296
投資その他の資産合計		13,430
固定資産合計		16,137
資産合計		49,121

（単位：百万円）

当中間会計期間  
（平成28年9月30日）

負債の部	
流動負債	
未払金	7,144
未払費用	3,762
未払法人税等	1,205
賞与引当金	733
その他	3 434
流動負債合計	13,279
固定負債	
退職給付引当金	2,301
役員退職慰労引当金	122
その他	9
固定負債合計	2,432
負債合計	15,712
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,184
利益剰余金合計	6,559
株主資本合計	33,229
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	179
評価・換算差額等合計	179
純資産合計	33,408
負債・純資産合計	49,121

## (2) 中間損益計算書

（単位：百万円）

当中間会計期間  
（自 平成28年4月1日  
至 平成28年9月30日）

営業収益		
委託者報酬		39,705
その他営業収益		356
営業収益合計		40,062
営業費用		
支払手数料		20,125
その他営業費用		5,997
営業費用合計		26,122
一般管理費	1	5,754
営業利益		8,184
営業外収益	2	165
営業外費用	3	59
経常利益		8,290
特別利益		-
特別損失	4	260
税引前中間純利益		8,029
法人税、住民税及び事業税		3,936
法人税等調整額		1,393
中間純利益		5,486

### (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）



	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 13,261	△ 13,261	△ 13,261
中間純利益	-	-	-	5,486	5,486	5,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△ 7,775	△ 7,775	△ 7,775
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,184	6,559	33,229

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	280	280	41,284
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 13,261
中間純利益	-	-	5,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	△ 100	△ 100	△ 100
当中間期変動額合計	△ 100	△ 100	△ 7,875
当中間期末残高	179	179	33,408

## 注記事項

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社

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

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。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## （２）無形固定資産

定額法によっております。

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

## ３．引当金の計上基準

### （１）賞与引当金

役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。

### （２）退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて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末要支給額を計上しております。

### （３）役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。

## ４．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

### （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。

### （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。

## （中間貸借対照表関係）

### １ 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成28年9月30日現在)
有形固定資産	273百万円

### ２ 保証債務

当中間会計期間（平成28年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,554百万円に対して保証を行っております。

## 3 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額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。

## (中間損益計算書関係)

## 1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	528百万円

## 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
受取配当金	62百万円
投資有価証券売却益	53百万円

## 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
為替差損	23百万円
投資有価証券売却損	16百万円

## 4 特別損失の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
MMF等償還関連費用	260百万円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30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	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
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28年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成28年 3月31日	平成28年 6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成28年9月30日)

## 金融商品の時価等に関する事項

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:百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	22,153	22,153	-
(2) 未収委託者報酬	9,521	9,521	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,511	6,511	-
資産合計	38,186	38,186	-
(1) 未払金	7,144	7,144	-
(2) 未払費用(*)	3,762	3,762	-
負債合計	10,906	10,906	-

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

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

## (1) 現金・預金及び(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、証券投資信託については、基準価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する事項については、注記事項(有価証券関係)をご参照下さい。

負 債

## (1) 未払金及び(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。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

区分	当中間会計期間
非上場株式	1,021
子会社株式	5,129
差入保証金	1,051

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。

（有価証券関係）

当中間会計期間（平成28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 5,129百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2．その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
（1）株式	111	55	56
（2）その他			
証券投資信託	3,994	3,627	366
小計	4,105	3,682	422
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	2,406	2,569	163
小計	2,406	2,569	163
合計	6,511	6,252	259

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額 1,021百万円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（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28年4月1日 至 平成28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28年4月1日 至 平成28年9月30日）

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. 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28年4月1日 至 平成28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28年4月1日 至 平成28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28年4月1日 至 平成28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28年4月1日 至 平成28年9月30日)
1株当たり純資産額	12,807.54円
1株当たり中間純利益金額	2,103.26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いません。

(注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。

当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,486
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,486
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
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。）。

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

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

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

#### 5 【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

提出日前1年以内において、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に該当する事実はありません。

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

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



## 第2 【その他の関係法人の概況】

## 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名称 みずほ信託銀行株式会社

資本金の額 247,369百万円（平成28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28年3月 末日現在）	事業の内容
大和証券株式会社	100,000	（注）

（注）金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

## 2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

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

## 3 【資本関係】

該当事項はありません。

## &lt;再信託受託会社の概要&gt;

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28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 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

（提出年月日）	（書類名）
平成28年4月22日	有価証券届出書、有価証券報告書（第22期）
平成28年10月25日	半期報告書（第23期中）、有価証券届出書の訂正届出書



**独立監査人の監査報告書**

平成28年 5月27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	高波 博之	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27年4月1日から平成28年3月31日までの第57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28年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成29年3月17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28年2月2日から平成29年2月1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29年2月1日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

**独立監査人の中間監査報告書**

平成28年11月24日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	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28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成28年4月1日から平成28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) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。



(注) 2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。