

**【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20日提出
【計算期間】	第23期(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50） 財形株投（一般財形30） 財形株投（年金・住宅財形30）
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼執行役社長 渡邊 国夫
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【連絡場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【電話番号】	03-3241-9511
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 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】

「財形株投」は、財形貯蓄制度（財形貯蓄、財形年金貯蓄、財形住宅貯蓄）をご利用いただける、給料天引方式による自動けいぞく投資専用の3本のファンドから構成されています。

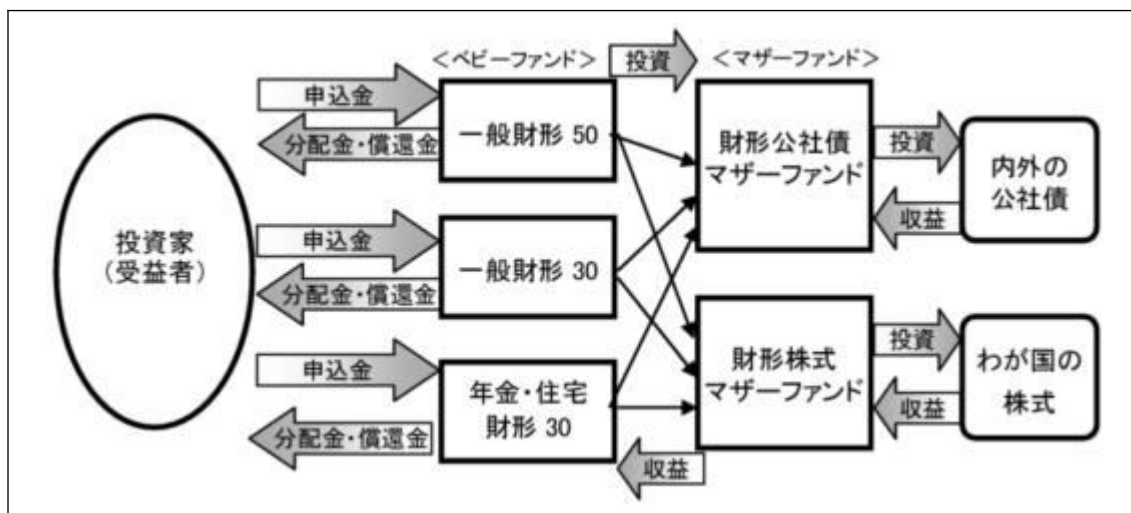
一般財形を利用する場合には、投資家のみなさまの選択により、「一般財形50」または「一般財形30」を、財形年金、財形住宅を利用する場合には、非課税の特典がある「年金・住宅財形30」を選べます。

各ファンドは、内外の公社債およびわが国の株式を実質的な主要投資対象とし、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。

各ファンドは、「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」を親投資信託（「マザーファンド」といいます。）とするファミリーファンド方式で運用します。「実質的な主要投資対象」とは、マザーファンドを通じて投資する、主要な投資対象という意味です。

##### ファミリーファンド方式について

各ファンドは、「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」を親投資信託（マザーファンド）とするファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様が出資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみをいいます。



- ・各マザーファンドの運用の基本方針等については、「第1 ファンドの状況 2 投資方針（参考）各マザーファンドの概要」をご参照ください。
- ・各ファンドは、マザーファンドの他に、公社債、株式等に直接投資する場合があります。
- ・分配金は税引き後、無手数料で再投資されます。  
「年金・住宅財形30」については、非課税枠内での分配金には税金がかかりません。詳しくは後述の「4 手数料等及び税金」をご覧ください。

##### 信託金の限度額

受益権の信託金限度額は、各ファンドにつき5,000億円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

## &lt;商品分類&gt;

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類は以下の通りです。

なお、ファンドに該当する商品分類及び属性区分は下記の表中に**網掛け表示**しております。

(財形株投(一般財形50))

(財形株投(一般財形30))

(財形株投(年金・住宅財形30))

## 《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	国 内	株 式
	海 外	債 券
		不動産投信
追 加 型	内 外	その他資産 ( )
		<b>資産複合</b>

## 《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	為替ヘッジ
株式	<b>年1回</b>	<b>グローバル</b>		
一般		<b>(日本を含む)</b>		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米	<b>ファミリーファンド</b>	<b>あり</b>
債券	年6回	欧州		<b>(適時ヘッジ)</b>
一般	(隔月)	アジア		
公債	年12回	オセアニア		
社債	(毎月)	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他債券	日々	中東		
クレジット属性	その他	アフリカ		
( )	( )	中近東 (中東)		
不動産投信		エマージング		
<b>その他資産</b>				
<b>(投資信託証券</b>				
<b>資産複合</b>				
<b>(株式、債券</b>				
<b>資産配分固定型))</b>				
資産複合				
( )				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

各ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産(その他資産(投資信託証券))と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産(資産複合)とが異なります。

す。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

《一般社団法人投資信託協会インターネットホームページアドレス》 <http://www.toushin.or.jp/>

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。（平成22年7月1日現在）

#### <商品分類表定義>

##### [単位型投信・追加型投信の区分]

- (1)単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われのないファンドをいう。
- (2)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われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

##### [投資対象地域による区分]

- (1)国内...目論見書又は投資信託約款において、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をいう。
- (2)海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外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をいう。

##### [投資対象資産(収益の源泉)による区分]

- (1)株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2)債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5)資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる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をいう。

##### [独立した区分]

- (1)MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2)MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3)ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

##### [補足分類]

- (1)インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

#### <属性区分表定義>

##### [投資対象資産による属性区分]

###### 株式

- (1)一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいう。
- (2)大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
- (3)中小型株...目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

## 債券

- (1)一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいう。
- (2)公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (3)社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (4)その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (5)格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)の「発行体」による区別のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記(1)から(4)に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

資産複合...以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

- (1)資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、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をいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
- (2)資産配分変更型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

## [ 決算頻度による属性区分 ]

- (1)年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
- (2)年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
- (3)年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
- (4)年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
- (5)年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- (6)日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- (7)その他...上記属性にあてはまらない全てのものをいう。

## [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、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をいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

## [ 投資形態による属性区分 ]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、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く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

## [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

- (1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替の

ヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

〔インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分〕

- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数...前記指数にあてはまらない全てのものをいう。

〔特殊型〕

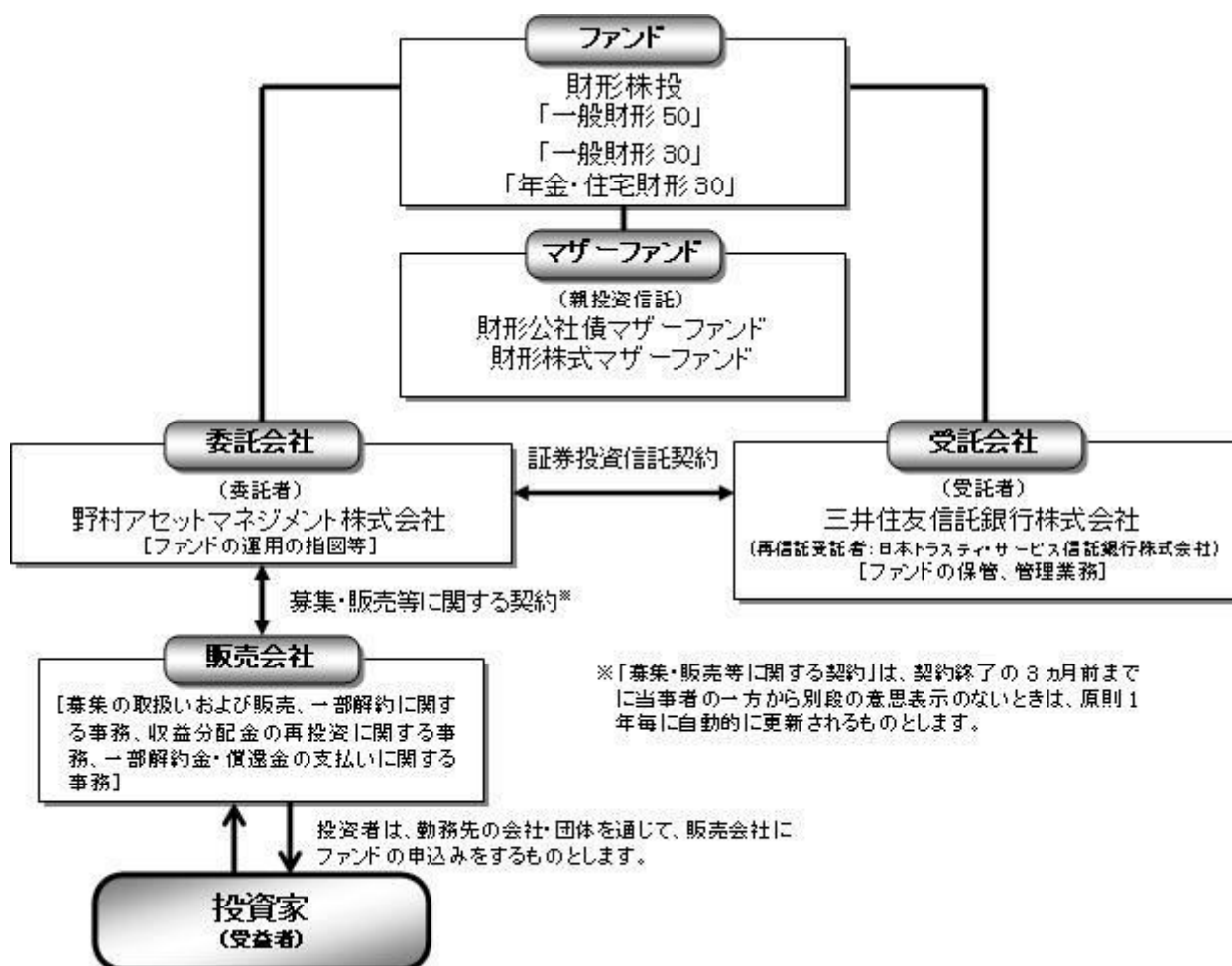
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

(2)【ファンドの沿革】

平成6年2月4日

信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】



委託会社の概況(平成29年3月末現在)

・名称

## 野村アセットマネジメント株式会社

## ・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

## ・資本金の額

17,180百万円

## ・会社の沿革

昭和34年(1959年)12月1日 野村証券投資信託委託株式会社として設立

平成9年(1997年)10月1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

平成12年(2000年)11月1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

平成15年(2003年)6月27日 委員会等設置会社へ移行

## ・大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋一丁目9番1号	5,150,693株	100%

## 2【投資方針】

## (1)【投資方針】

## 「一般財形50」

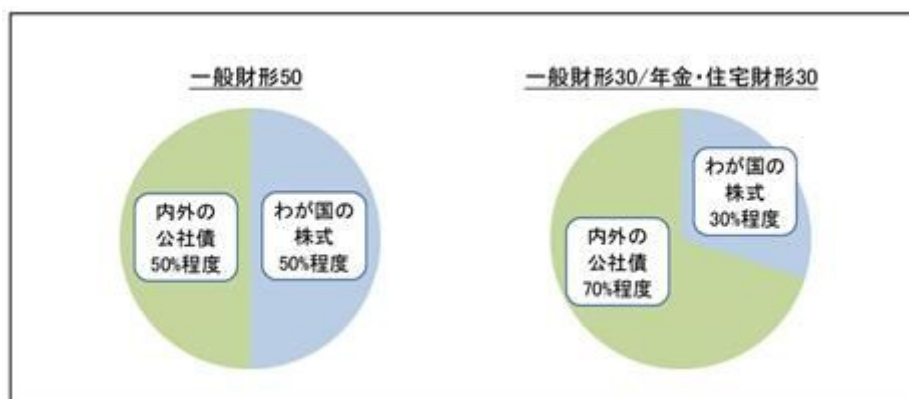
内外の公社債へ実質的に投資することにより安定した収益の確保を図り、わが国の株式へ実質的に投資することにより信託財産の成長をめざします。

株式への実質的な投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の50%とし、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。

## 「一般財形30」および「年金・住宅財形30」

内外の公社債へ実質的に投資することにより安定した収益の確保を図り、わが国の株式へ実質的に投資することにより信託財産の成長をめざします。

株式への実質的な投資にあたっては、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、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。



なお、資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## （２）【投資対象】

内外の公社債およびわが国の株式を実質的な主要投資対象とします。

各ファンドは、「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」受益証券への投資を通じて、実質的に内外の公社債およびわが国の株式に投資を行いません。なお、公社債、株式等に直接投資する場合があります。

なお、デリバティブの使用は、ヘッジ目的に限定します。

### 有価証券の指図範囲（約款第16条第1項）

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である財形株式マザーファンドおよび財形公社債マザーファンドの受益証券のほか、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. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債権（以下「分離型新株引受権付社債権」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 5の2. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 5の3. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
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、第1号から第6号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。）および新株予約権証券（外国または外国の者が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. 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号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
13. 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。）

なお、第1号の証券または証書および第7号の証券または証書のうち第1号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、第2号から第5号の3までの証券および第7号の証券のうち第2号から第5号の3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。

### 金融商品の指図範囲（約款第16条第2項）

委託者は、信託金を、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。



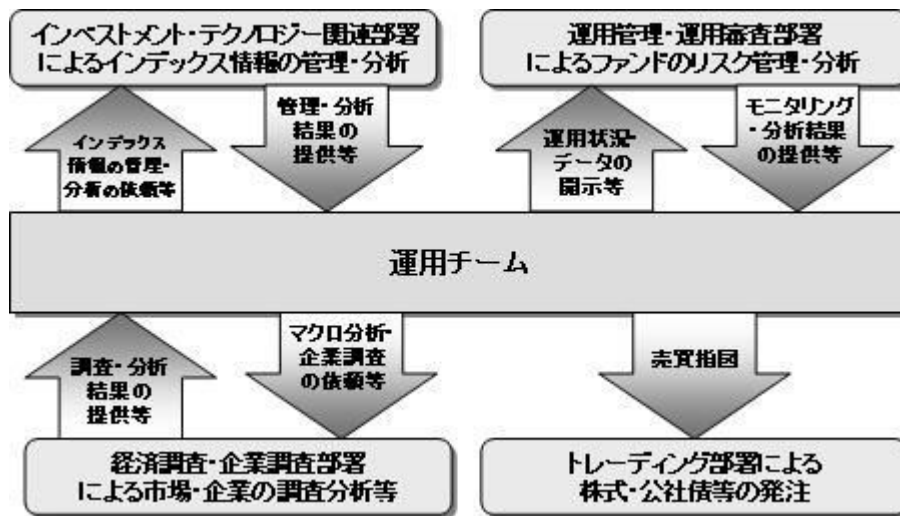
1. 預金
2. 指定金銭信託（上記「（2）投資対象 有価証券の指図範囲」に掲げるものを除く。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

その他の投資対象

1. 先物取引等
2. スワップ取引

### （3）【運用体制】

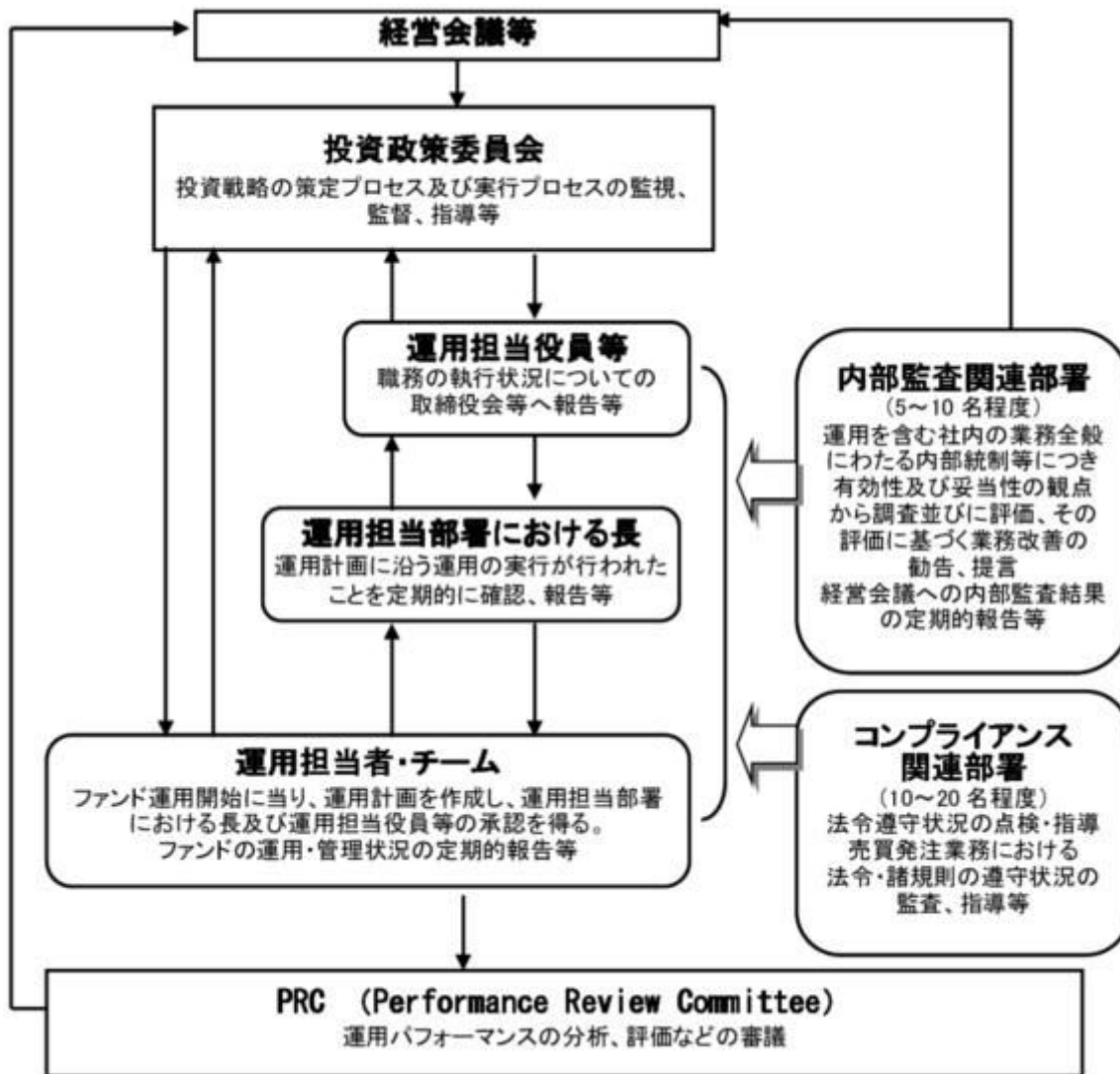
ファンドの運用体制は以下の通りです。



運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

当社では、ファンドの運用に関する社内規程として、運用担当者に関する規程並びにスワップ取引、信用リスク管理、資金の借入、外国為替の予約取引等、信用取引等に関して各々、取扱い基準を設けております。

ファンドを含む委託会社における投資信託の内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りです。



#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

運用の外部委託を行う場合、「運用の外部委託先」に対しては、外部委託先が行った日々の約定について、投資ガイドラインに沿ったものであるかを確認しています。また、コンプライアンスレポートの提出を義務付け、定期的に管理状況に関する報告を受けています。さらに、外部委託先の管理体制、コンプライアンス体制等について調査ならびに評価を行い、定期的に商品に関する委員会に報告しています。

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

年1回の毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

分配金額は、委託会社が決定するものとし、利子・配当収入等を中心に安定的に行いません。

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行いません。

利子・配当収入とは、配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

売買益とは、売買損益に評価損益を加減した利益金額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

\* 委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

#### ファンドの決算日

原則として**毎年2月1日**(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

ただし、1日もしくは2日のいずれかが休業日のときは、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。

#### 分配金のお支払い

分配金は税引き後 無手数料で再投資されます。

「年金・住宅財形30」については、非課税枠内での分配金には税金がかかりません。詳しくは後述の「4 手数料等及び税金」をご覧ください。

なお、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。

### (5) 【投資制限】

#### 各ファンドに共通

株式への投資割合(運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限)

「一般財形50」

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以内とします。

「一般財形30」および「年金・住宅財形30」

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

外貨建資産への投資割合(運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限)

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以内とします。

デリバティブの使用は、ヘッジ目的に限定します。

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デリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。(運用の基本方針 2 運用方法 (3) 投資制限)

投資信託証券への投資割合

投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)への投資は行ないません。

先物取引等の運用指図・目的・範囲(約款第20条)

( ) 委託者は、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。以下同じ。)、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。以下同じ。)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。以下同じ。)ならびに外国の金融商品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るものとします(以下同じ。)

1. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジの対象とする有価証券(以下、「ヘッジ対象有価証券」といいます。)の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象有価証券の組入可能額(組入ヘッジ対象有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、且つ信託財産が限月までに受取る組入有価証券に係る利払金および償還金等(株式、株価指数に係る先物取引の買建においては、信託財産が未収配当金として計上している額を含むものとし、この額には信託財産が当該限月を超えて受取る配当金も含まれます。)ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」第1号から第4号で掲げる金融商品で運用している額の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、本条で規定する全オプション取引に係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。

( )委託者は、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、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係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. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合せてヘッジ対象とする外貨建資産(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。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属するヘッジ対象と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(信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産純資産総額に占めるヘッジ対象とす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。)との合計額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合せて、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、且つ本条で規定する全オプション取引に係る支払いプレミアム額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。

( )委託者は、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、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品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. 先物取引の売建およびコール・オプションの売付の指図は、建玉の合計額が、ヘッジ対象とする金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象 金融商品の指図範囲」第1号から第4号に掲げる金融商品で運用されて

- いるものをいい、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. 先物取引の買建およびプット・オプションの売付の指図は、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係る利払金および償還金等ならびに上記「(2)投資対象金融商品の指図範囲」第1号から第4項に掲げる金融商品で運用している額(以下本号において「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。ただし、ヘッジ対象金利商品が外貨建て、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係る利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付の指図は、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、且つ本条で規定する全オプション取引に係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。

#### スワップ取引の運用指図・目的・範囲(約款第20条の2)

- ( )委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用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、異なった受取り金利または異なった受取り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。
- ( )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。
- ( )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マザーファンド(財形株式マザーファンド受益証券および財形公社債マザーファンド受益証券をいいます。以下本条において同じ。)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「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)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、委託者は速やかに、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。
- ( )上記( )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。
- ( )スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- ( )委託者は、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。

#### 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合(運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限)

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の

20%以内とします。

#### 投資する株式等の範囲（約款第18条）

委託者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、運用の基本方針の範囲内（新株引受権証券および新株予約権証券については、運用の基本方針に特別の規定がない場合、株式の範囲と同じものとする。）で、金融商品取引所に上場（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および金融商品取引所に準ずる市場において取引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。

#### 同一銘柄の株式への投資割合（運用の基本方針 2. 運用方法（3）投資制限）

同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

#### 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合（運用の基本方針 2. 運用方法（3）投資制限）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

#### 同一銘柄の転換社債等への投資割合（運用の基本方針 2. 運用方法（3）投資制限）

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債 への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

転換社債型新株予約権付社債とは、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（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みます。）をいいます。

#### 信用取引の指図範囲（約款第19条の2）

( )委託者は、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り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り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。

( )上記( )の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株式について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。

1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）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（前号のものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### 有価証券の貸付の指図および範囲（約款第22条の2）

( )委託者は、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各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、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の50%を超えないものとします。

- ( )上記( )に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、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。
- ( )委託者は、有価証券の貸付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。

#### 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第24条）

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（約款第25条）

- ( )委託者は、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。
- ( )委託者は、外国為替の売買の予約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。

#### 資金の借入れ（約款第33条の2）

- ( )委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、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。
- ( )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解約代金入金日までの間もしく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、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ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。
- ( )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。
- ( )借入金の利息は信託財産中より支弁します。

#### 同一の法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

同一の法人の発行する株式について、次の( )の数が( )の数を超えることとなる場合には、当該株式を信託財産で取得することを受託会社に指図しないものとします。

- ( )委託者が運用の指図を行なうすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数
- ( )当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

(参考)各マザーファンドの概要

### 「財形公社債マザーファンド」

#### 運用の基本方針

約款第11条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1. 基本方針

この投資信託は、内外の公社債への投資により、安定した収益の確保を目標として安定運用を行ないます。

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

内外の公社債を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

内外の公社債への投資により、安定した収益の確保を図ります。

なお、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

有価証券先物取引等は約款第12条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第12条の2の範囲で行ないます。

外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以内とします。

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デリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

## 「財形株式マザーファンド」

### 運用の基本方針

約款第11条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に運用を行ないます。

## 2. 運用方法

### (1) 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。

### (2) 投資態度

東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資効果をめざします。

非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。

なお、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。



同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

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デリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

### 3【投資リスク】

#### 基準価額の変動要因

ファンドの基準価額は、投資を行なっている有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様へ帰属します。

したがって、ファンドにおいて、投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金が割り込むことがあります。なお、投資信託は預貯金と異なります。

#### [株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。

#### [債券価格変動リスク]

債券（公社債等）は、市場金利や信用度の変動により価格が変動します。ファンドは実質的に債券に投資を行ないますので、これらの影響を受けます。

#### [為替変動リスク]

外貨建資産に投資した場合には為替変動の影響を受ける場合があります。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

#### その他の留意点

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。

資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。

ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。

有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。

ファンドが投資対象とする「財形株式マザーファンド」において、当該マザーファンドの基準価額と対象インデックスは、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、マザーファンドの投資成果が対象インデックスとの連動または上回ることを保証するものではありません。

投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

投資者の個別元本（追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本）の状況によっては、分配金額の

一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。

分配金は、預貯金の利息とは異なりファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後の純資産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行なった場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

## 委託会社におけるリスクマネジメント体制

### リスク管理関連の委員会

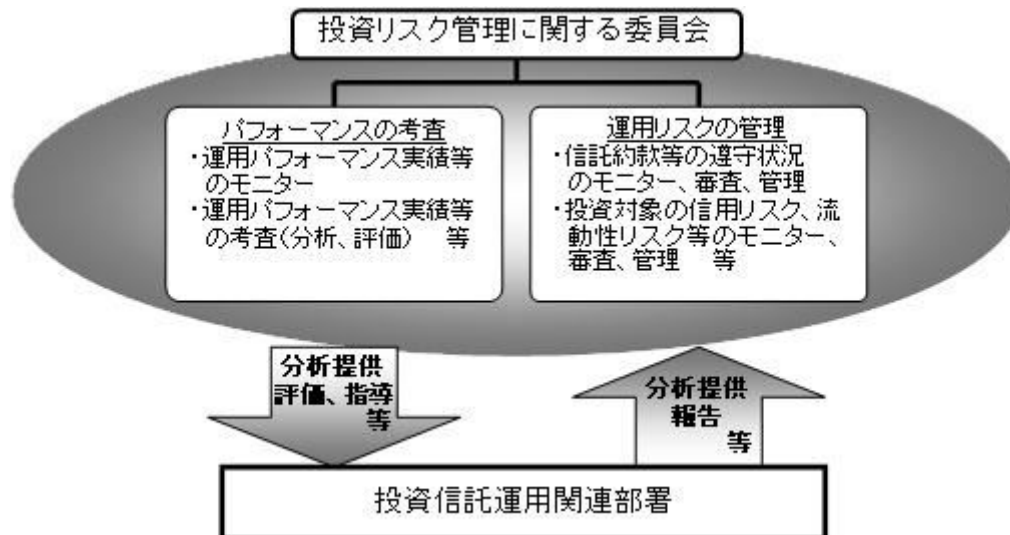
#### パフォーマンスの考査

投資信託の信託財産についてパフォーマンスに基づいた定期的な考査（分析、評価）の結果の報告、審議を行ないます。

#### 運用リスクの管理

投資信託の信託財産の運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用部門その他関連部署への是正勧告を行なうことにより、適切な管理を行ないます。

### リスク管理体制図



投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

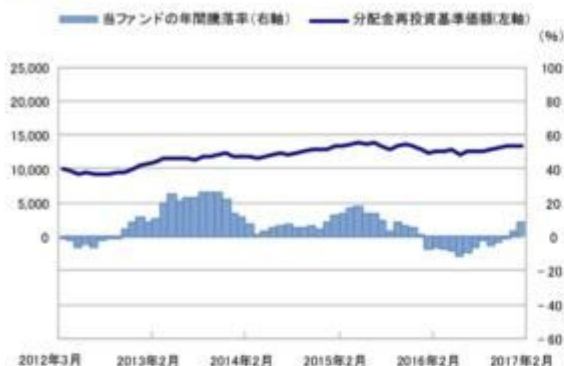
## リスクの定量的比較

(2012年3月末～2017年2月末:月次)

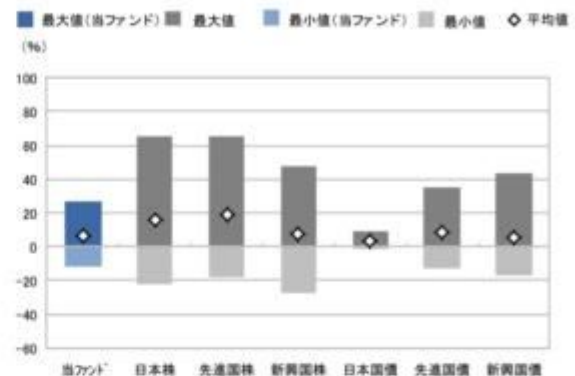
〈ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移〉

〈ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較〉

## ●一般財形 50



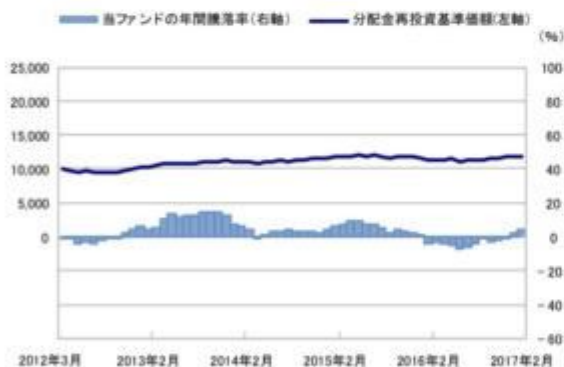
- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2012年3月末を10,000として指数化しております。
- \* 年間騰落率は、2012年3月から2017年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。



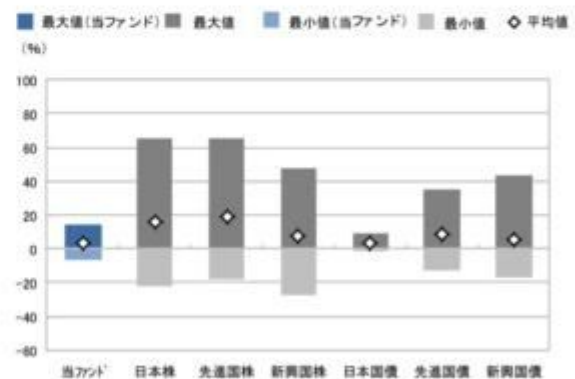
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	26.4	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値(%)	△ 11.5	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 0.2	△ 12.3	△ 17.4
平均値(%)	6.3	16.3	18.6	7.2	3.1	9.0	5.3

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2012年3月から2017年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## ●一般財形 30



- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2012年3月末を10,000として指数化しております。
- \* 年間騰落率は、2012年3月から2017年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。



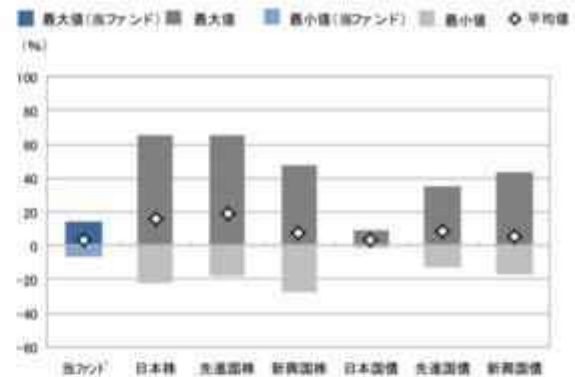
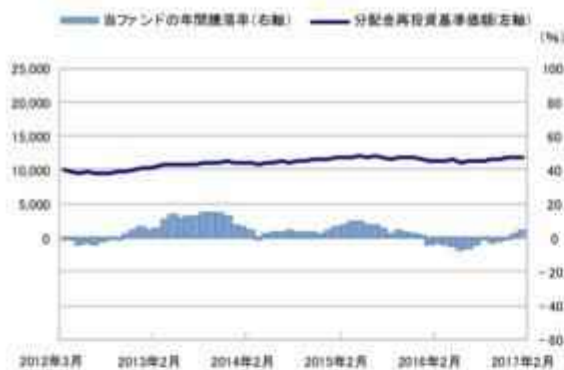
	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	14.2	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値(%)	△ 6.8	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 0.2	△ 12.3	△ 17.4
平均値(%)	3.3	16.3	18.6	7.2	3.1	9.0	5.3

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2012年3月から2017年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## 〈ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移〉

## 〈ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較〉

## ●年金・住宅財形 30



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	14.2	65.0	65.7	47.4	9.3	34.9	43.7
最小値(%)	△6.8	△22.0	△17.5	△27.4	△0.2	△12.3	△17.4
平均値(%)	3.3	16.3	18.6	7.2	3.1	9.0	5.3

- 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2012年3月末を10,000として指数化しております。
- 年間騰落率は、2012年3月から2017年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 2012年3月から2017年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンド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、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

## ＜代表的な資産クラスの指数＞

- 日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
- 先進国株：MSCI-KOKUSAI指数 (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、ヘッジなし、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・ディバーシファイド (円ベース)

## ■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)・・・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)は、株式会社東京証券取引所 (株東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI指数 (配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数 (配当込み、円ベース)、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)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCI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・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし、円ベース)・・・「シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし、円ベース)」は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスで、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)・・・「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・ディバーシファイド (円ベース)」(ここでは「指数」とよびます)についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社 (以下、JPM) がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。米国のJP Morgan Securities LLC (ここでは「JPM」と呼びます) (「指数スポンサー」)は、指数に関する証券、金融商品または取引 (ここでは「プロダクト」と呼びます) についての奨励、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または承認を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMはNASDAQ、NYSE、SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA、JPMS、JP Morgan Securities PLC、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

(出所：株式会社野村総合研究所、Citigroup Index LLC 他)

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

なし

## (2)【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

## (3)【信託報酬等】

信託報酬の総額は、各ファンドにつき、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の158.76（税抜年10,000分の147）以内（平成29年 4月20日現在年10,000分の158.76（税抜年10,000分の147））の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り（税抜）とします。

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
年10,000分の34.5	年10,000分の107.5	年10,000分の 5.0

\* 上記配分は、平成29年 4月20日現在の信託報酬率における配分です。

上記の信託報酬の総額は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日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払われます。

## 支払先の役務の内容

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等	購入後の情報提供、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および事務手続き等	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等

## (4)【その他の手数料等】

ファンドにおいて一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行なった場合、当該借入金の利息は信託財産から支払われます。

ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産から支払われます。

ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係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、外貨建資産の保管等に要する費用は信託財産から支払われます。

監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支払いのときに信託財産から支払われます。

これらの費用等の中には、運用状況等により変動するものがあり、事前に料率、上限額等を表示することができないものがあります。

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（国税（所得税及び復興特別所得税）15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、「一般財形50」は配当控除の適用が可能です。また、「一般財形30」、「年金・住宅財形30」は配当控除の適用はありません。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により20.315%（国税15.315%および地方税5%）の税率が適用されます。

「年金・住宅財形30」で、財形貯蓄制度（「財形住宅貯蓄」または「財形年金貯蓄」）をご利用の場合には、積立金と収益分配金の合計額が、申告された限度額（「財形住宅貯蓄」と「財形年金貯蓄」を合わせて最高550万円）内である場合には、期中分配金および解約益に関しては、所得税および地方税はかかりません。ただし、住宅の取得などもしくは年金の受取り以外の目的で払戻される場合には、災害による損害を受けた等の法令で定められた事由がある場合を除き、追徴課税される場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

換金（解約）時および償還時の課税について

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が課税対象（譲渡所得）となります。

（平成29年 4月20日現在のもので、今後変更になる場合があります。）

個別元本について

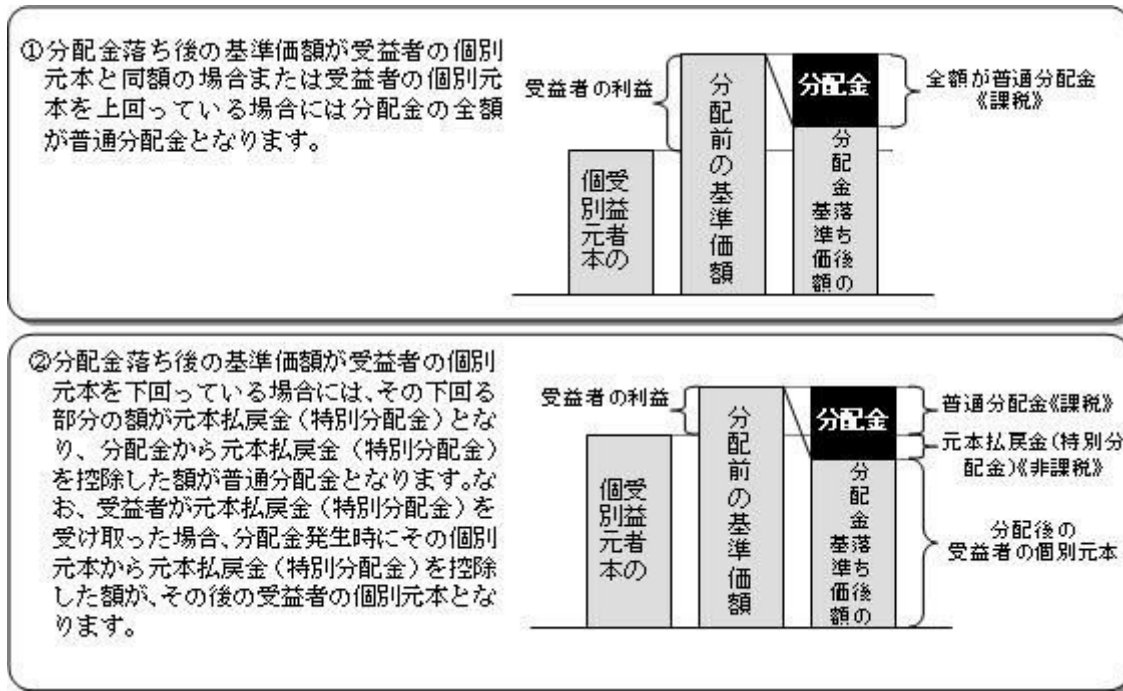
追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

分配金の課税について

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）」（受

益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）があります。



上図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（平成29年2月末現在）が変更になる場合があります。

\* 税金の取扱いの詳細については、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】

以下は平成29年 2月28日現在の運用状況であります。

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

### (1)【投資状況】

#### 財形株投（一般財形50）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	2,624,867,613	97.66
現金・預金・その他資産（負債控除後）		62,618,722	2.33
合計（純資産総額）		2,687,486,335	100.00

#### 財形株投（一般財形30）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	2,019,966,815	97.67

現金・預金・その他資産（負債控除後）		47,992,251	2.32
合計（純資産総額）		2,067,959,066	100.00

## 財形株投（年金・住宅財形30）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	2,138,604,077	97.57
現金・預金・その他資産（負債控除後）		53,184,496	2.42
合計（純資産総額）		2,191,788,573	100.00

## （参考）財形株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	2,538,656,010	98.45
現金・預金・その他資産（負債控除後）		39,736,657	1.54
合計（純資産総額）		2,578,392,667	100.00

## その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。  
評価にあたっては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。

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	35,282,000	1.36

## （参考）財形公社債マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	745,303,000	17.72
地方債証券	日本	1,013,937,196	24.11
特殊債券	日本	1,770,983,445	42.11
社債券	日本	573,558,188	13.63
現金・預金・その他資産（負債控除後）		101,308,564	2.40
合計（純資産総額）		4,205,090,393	100.00

## （2）【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 財形株投（一般財形50）



順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	財形株式マザーファンド	976,523,545	1.3542	1,322,408,185	1.3615	1,329,536,806	49.47
2	日本	親投資信託 受益証券	財形公社債マザーファンド	940,553,883	1.3762	1,294,390,254	1.3772	1,295,330,807	48.19

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.66
合 計	97.66

## 財形株投(一般財形30)

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	財形公社債マザーファンド	1,025,382,877	1.3761	1,411,029,378	1.3772	1,412,157,298	68.28
2	日本	親投資信託 受益証券	財形株式マザーファンド	446,426,381	1.3543	604,595,248	1.3615	607,809,517	29.39

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.67
合 計	97.67

## 財形株投(年金・住宅財形30)

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	財形公社債マザーファンド	1,087,413,496	1.3762	1,496,498,454	1.3772	1,497,585,866	68.32
2	日本	親投資信託 受益証券	財形株式マザーファンド	470,817,636	1.3543	637,628,325	1.3615	641,018,211	29.24

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	97.57
合 計	97.57

(参考) 財形株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	13,800	6,546.00	90,334,800	6,365.00	87,837,000	3.40
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	84,800	727.40	61,683,520	738.40	62,616,320	2.42
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	9,000	4,958.00	44,622,000	4,751.00	42,759,000	1.65
4	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	5,000	8,805.00	44,025,000	8,362.00	41,810,000	1.62
5	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	9,000	4,413.00	39,717,000	4,377.00	39,393,000	1.52
6	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	10,200	3,415.00	34,833,000	3,489.00	35,587,800	1.38
7	日本	株式	KDDI	情報・通信業	11,100	3,036.00	33,699,600	2,939.00	32,622,900	1.26
8	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	152,000	208.70	31,722,400	209.70	31,874,400	1.23
9	日本	株式	ソニー	電気機器	8,000	3,410.00	27,280,000	3,478.00	27,824,000	1.07
10	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	7,000	3,631.00	25,417,000	3,757.00	26,299,000	1.01
11	日本	株式	キーエンス	電気機器	600	43,860.00	26,316,000	43,460.00	26,076,000	1.01
12	日本	株式	ファナック	電気機器	1,100	22,155.00	24,370,500	22,125.00	24,337,500	0.94
13	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	4,400	4,768.00	20,979,200	5,222.00	22,976,800	0.89
14	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	8,400	2,717.00	22,822,800	2,667.00	22,402,800	0.86
15	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	2,200	10,320.00	22,704,000	10,155.00	22,341,000	0.86
16	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	4,500	4,730.00	21,285,000	4,919.00	22,135,500	0.85
17	日本	株式	三菱商事	卸売業	8,400	2,573.00	21,613,200	2,534.50	21,289,800	0.82
18	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	4,700	4,558.00	21,422,600	4,400.00	20,680,000	0.80
19	日本	株式	キヤノン	電気機器	6,100	3,292.00	20,081,200	3,281.00	20,014,100	0.77
20	日本	株式	信越化学工業	化学	2,100	9,766.00	20,508,600	9,503.00	19,956,300	0.77
21	日本	株式	三菱電機	電気機器	12,100	1,742.50	21,084,250	1,647.50	19,934,750	0.77
22	日本	株式	村田製作所	電気機器	1,200	14,640.00	17,568,000	16,150.00	19,380,000	0.75
23	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	12,100	1,465.00	17,726,500	1,512.00	18,295,200	0.70
24	日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	4,000	4,153.00	16,612,000	4,481.00	17,924,000	0.69
25	日本	株式	三菱地所	不動産業	8,000	2,159.50	17,276,000	2,195.00	17,560,000	0.68
26	日本	株式	三井物産	卸売業	10,200	1,659.00	16,921,800	1,719.00	17,533,800	0.68
27	日本	株式	花王	化学	3,000	5,624.00	16,872,000	5,801.00	17,403,000	0.67
28	日本	株式	日立製作所	電気機器	27,000	648.20	17,501,400	618.80	16,707,600	0.64
29	日本	株式	野村ホールディングス	証券、商品先物取引業	22,900	721.20	16,515,480	729.30	16,700,970	0.64
30	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	900	18,505.00	16,654,500	18,380.00	16,542,000	0.64

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.33
		建設業	2.86
		食料品	4.36
		繊維製品	0.70

パルプ・紙	0.25
化学	6.63
医薬品	4.69
石油・石炭製品	0.55
ゴム製品	0.94
ガラス・土石製品	0.98
鉄鋼	1.32
非鉄金属	0.96
金属製品	0.69
機械	5.02
電気機器	12.36
輸送用機器	9.12
精密機器	1.50
その他製品	1.70
電気・ガス業	1.75
陸運業	4.12
海運業	0.25
空運業	0.57
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	7.66
卸売業	4.50
小売業	4.57
銀行業	8.37
証券、商品先物取引業	1.22
保険業	2.69
その他金融業	1.23
不動産業	2.45
サービス業	3.65
合計	98.45

## (参考) 財形公社債マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	300,000,000	102.20	306,606,500	102.50	307,515,000	0.3	2025/12/20	7.31
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 3回	160,000,000	100.84	161,344,500	100.88	161,422,400	0.1	2020/3/20	3.83
3	日本	地方債証券	共同発行市場地 方債 公募第7 6回	117,800,000	103.50	121,924,178	103.35	121,751,012	1.4	2019/7/25	2.89
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	110,000,000	104.24	114,667,000	104.72	115,196,400	0.6	2024/6/20	2.73

5	日本	特殊債券	日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第7回	100,000,000	114.28	114,282,000	113.96	113,965,000	2.7	2022/6/20	2.71
6	日本	社債券	三菱東京UFJ銀行 第9回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	108.21	108,216,000	108.01	108,014,000	2.69	2020/2/27	2.56
7	日本	特殊債券	地方公共団体金融機構債券 第21回	100,000,000	105.51	105,510,000	105.36	105,368,000	1.365	2021/2/26	2.50
8	日本	特殊債券	関西国際空港社債 財投機関債第38回	100,000,000	105.19	105,197,000	105.09	105,094,000	1.112	2021/12/20	2.49
9	日本	特殊債券	中日本高速道路社債 第33回	100,000,000	104.79	104,799,000	104.69	104,694,000	1.084	2021/9/17	2.48
10	日本	地方債証券	北海道 公募平成21年度第14回	100,000,000	104.65	104,654,000	104.53	104,538,000	1.52	2020/2/26	2.48
11	日本	社債券	三菱東京UFJ銀行 第119回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	103.69	103,696,000	103.61	103,617,000	1.035	2020/10/15	2.46
12	日本	特殊債券	日本政策投資銀行社債 財投機関債第5回	100,000,000	103.59	103,597,000	103.58	103,585,000	1.745	2019/3/20	2.46
13	日本	地方債証券	神奈川県 公募第161回	100,000,000	103.35	103,350,000	103.21	103,217,000	1.57	2019/3/20	2.45
14	日本	地方債証券	福島県 公募平成20年度第1回	100,000,000	103.16	103,160,000	103.01	103,017,000	1.73	2018/11/28	2.44
15	日本	特殊債券	住宅金融支援機構債券 財投機関債第21回	100,000,000	103.15	103,151,000	102.99	102,993,000	1.92	2018/9/20	2.44
16	日本	特殊債券	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第19回	100,000,000	102.78	102,787,000	102.62	102,623,000	2.01	2018/6/20	2.44
17	日本	地方債証券	東京都 公募第658回	100,000,000	102.69	102,698,000	102.53	102,535,000	1.95	2018/6/20	2.43
18	日本	国債証券	国庫債券 利付(5年)第119回	100,000,000	100.69	100,691,000	100.76	100,763,000	0.1	2019/6/20	2.39
19	日本	特殊債券	東日本高速道路 第28回	100,000,000	100.68	100,685,000	100.65	100,654,000	0.248	2019/12/20	2.39
20	日本	特殊債券	阪神高速道路 第11回	100,000,000	100.60	100,600,000	100.55	100,558,000	0.319	2018/12/20	2.39
21	日本	社債券	みずほ銀行 第34回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100.56	100,564,000	100.53	100,537,000	0.395	2018/7/25	2.39
22	日本	特殊債券	中日本高速道路社債 第49回	100,000,000	100.57	100,576,000	100.52	100,524,000	0.501	2018/3/20	2.39
23	日本	特殊債券	農林債券 利付第762回い号	100,000,000	100.54	100,545,000	100.51	100,514,000	0.3	2018/11/27	2.39
24	日本	社債券	三井住友信託銀行 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100.51	100,517,000	100.50	100,508,000	0.213	2019/10/28	2.39
25	日本	地方債証券	熊本県 公募(5年)平成25年度第1回	100,000,000	100.53	100,530,000	100.48	100,485,000	0.35	2018/7/31	2.38
26	日本	地方債証券	川崎市 公募第39回	100,000,000	100.45	100,456,000	100.41	100,419,000	0.209	2019/3/20	2.38
27	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第316回	100,000,000	100.12	100,121,000	100.10	100,101,000	0.07	2021/3/26	2.38
28	日本	特殊債券	東日本高速道路 第36回	100,000,000	100.10	100,109,000	100.08	100,085,000	0.06	2021/6/18	2.38

29	日本	特殊債券	商工債券 利付 第742回い号	100,000,000	100.03	100,031,777	100.03	100,031,777	0.4	2017/3/27	2.37
30	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第26 8回	100,000,000	100.03	100,031,777	100.03	100,031,777	0.4	2017/3/27	2.37

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	17.72
地方債証券	24.11
特殊債券	42.11
社債券	13.63
合 計	97.59

## 【投資不動産物件】

財形株投(一般財形50)

該当事項はありません。

財形株投(一般財形30)

該当事項はありません。

財形株投(年金・住宅財形30)

該当事項はありません。

(参考)財形株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)財形公社債マザーファンド

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

財形株投(一般財形50)

該当事項はありません。

財形株投(一般財形30)

該当事項はありません。

財形株投(年金・住宅財形30)

該当事項はありません。

## （参考）財形株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては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。

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	ミニTOPIX先物(2017年03月限)	買建	23	日本円	35,256,574	35,282,000	1.36

## （参考）財形公社債マザーファンド

該当事項はありません。

## （3）【運用実績】

## 【純資産の推移】

## 財形株投（一般財形50）

平成29年2月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第14計算期間	(2008年 2月 4日)	2,020	2,021	0.9621	0.9626
第15計算期間	(2009年 2月 2日)	1,534	1,535	0.7477	0.7482
第16計算期間	(2010年 2月 1日)	1,832	1,834	0.8067	0.8072
第17計算期間	(2011年 2月 1日)	1,983	1,985	0.8131	0.8136
第18計算期間	(2012年 2月 1日)	1,934	1,936	0.7484	0.7489
第19計算期間	(2013年 2月 4日)	2,212	2,213	0.8391	0.8396
第20計算期間	(2014年 2月 3日)	2,347	2,348	0.9357	0.9362
第21計算期間	(2015年 2月 2日)	2,561	2,562	1.0158	1.0163
第22計算期間	(2016年 2月 1日)	2,636	2,637	1.0374	1.0379
第23計算期間	(2017年 2月 1日)	2,706	2,707	1.0622	1.0627
	2016年 2月末日	2,502		0.9805	
	3月末日	2,523		1.0023	
	4月末日	2,524		1.0000	
	5月末日	2,540		1.0139	
	6月末日	2,443		0.9652	
	7月末日	2,521		0.9921	
	8月末日	2,533		0.9938	
	9月末日	2,542		0.9945	
	10月末日	2,617		1.0187	

11月末日	2,668		1.0445	
12月末日	2,725		1.0612	
2017年 1月末日	2,702		1.0606	
2月末日	2,687		1.0641	

## 財形株投（一般財形30）

平成29年2月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第14計算期間	(2008年 2月 4日)	1,143	1,144	0.9828	0.9833
第15計算期間	(2009年 2月 2日)	1,144	1,145	0.8527	0.8532
第16計算期間	(2010年 2月 1日)	1,325	1,326	0.8920	0.8925
第17計算期間	(2011年 2月 1日)	1,433	1,434	0.8929	0.8934
第18計算期間	(2012年 2月 1日)	1,471	1,472	0.8498	0.8503
第19計算期間	(2013年 2月 4日)	1,636	1,637	0.9057	0.9062
第20計算期間	(2014年 2月 3日)	1,718	1,719	0.9617	0.9622
第21計算期間	(2015年 2月 2日)	1,878	1,878	1.0067	1.0072
第22計算期間	(2016年 2月 1日)	1,946	1,947	1.0172	1.0177
第23計算期間	(2017年 2月 1日)	2,069	2,070	1.0273	1.0278
	2016年 2月末日	1,889		0.9850	
	3月末日	1,915		0.9972	
	4月末日	1,915		0.9959	
	5月末日	1,932		1.0039	
	6月末日	1,900		0.9755	
	7月末日	1,944		0.9900	
	8月末日	1,952		0.9908	
	9月末日	1,958		0.9911	
	10月末日	1,992		1.0046	
	11月末日	2,010		1.0186	
	12月末日	2,062		1.0277	
	2017年 1月末日	2,068		1.0265	
	2月末日	2,067		1.0281	

## 財形株投（年金・住宅財形30）

平成29年2月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第14計算期間	(2008年 2月 4日)	1,351	1,352	0.9950	0.9955
第15計算期間	(2009年 2月 2日)	1,351	1,352	0.8631	0.8636

第16計算期間	(2010年 2月 1日)	1,491	1,492	0.9029	0.9034
第17計算期間	(2011年 2月 1日)	1,563	1,564	0.9037	0.9042
第18計算期間	(2012年 2月 1日)	1,569	1,570	0.8600	0.8605
第19計算期間	(2013年 2月 4日)	1,794	1,795	0.9166	0.9171
第20計算期間	(2014年 2月 3日)	1,884	1,885	0.9732	0.9737
第21計算期間	(2015年 2月 2日)	2,033	2,034	1.0187	1.0192
第22計算期間	(2016年 2月 1日)	2,088	2,089	1.0294	1.0299
第23計算期間	(2017年 2月 1日)	2,176	2,177	1.0395	1.0400
	2016年 2月末日	2,031		0.9968	
	3月末日	2,040		1.0091	
	4月末日	2,043		1.0079	
	5月末日	2,066		1.0160	
	6月末日	2,038		0.9872	
	7月末日	2,074		1.0019	
	8月末日	2,070		1.0027	
	9月末日	2,055		1.0029	
	10月末日	2,089		1.0166	
	11月末日	2,123		1.0308	
	12月末日	2,177		1.0400	
	2017年 1月末日	2,175		1.0388	
	2月末日	2,191		1.0404	

## 【分配の推移】

## 財形株投（一般財形50）

	計算期間	1口当たりの分配金
第14計算期間	2007年 2月 2日～2008年 2月 4日	0.0005円
第15計算期間	2008年 2月 5日～2009年 2月 2日	0.0005円
第16計算期間	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	0.0005円
第17計算期間	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.0005円
第18計算期間	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	0.0005円
第19計算期間	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005円
第20計算期間	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005円
第21計算期間	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005円
第22計算期間	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005円
第23計算期間	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005円

## 財形株投（一般財形30）

	計算期間	1口当たりの分配金
--	------	-----------



第14計算期間	2007年 2月 2日～2008年 2月 4日	0.0005円
第15計算期間	2008年 2月 5日～2009年 2月 2日	0.0005円
第16計算期間	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	0.0005円
第17計算期間	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.0005円
第18計算期間	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	0.0005円
第19計算期間	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005円
第20計算期間	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005円
第21計算期間	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005円
第22計算期間	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005円
第23計算期間	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005円

## 財形株投（年金・住宅財形30）

	計算期間	1口当たりの分配金
第14計算期間	2007年 2月 2日～2008年 2月 4日	0.0005円
第15計算期間	2008年 2月 5日～2009年 2月 2日	0.0005円
第16計算期間	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	0.0005円
第17計算期間	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.0005円
第18計算期間	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	0.0005円
第19計算期間	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	0.0005円
第20計算期間	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	0.0005円
第21計算期間	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	0.0005円
第22計算期間	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	0.0005円
第23計算期間	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	0.0005円

## 【収益率の推移】

## 財形株投（一般財形50）

	計算期間	収益率
第14計算期間	2007年 2月 2日～2008年 2月 4日	10.3%
第15計算期間	2008年 2月 5日～2009年 2月 2日	22.2%
第16計算期間	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	8.0%
第17計算期間	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.9%
第18計算期間	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	7.9%
第19計算期間	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	12.2%
第20計算期間	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	11.6%
第21計算期間	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	8.6%
第22計算期間	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	2.2%
第23計算期間	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	2.4%

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### 財形株投（一般財形30）

	計算期間	収益率
第14計算期間	2007年 2月 2日～2008年 2月 4日	5.9%
第15計算期間	2008年 2月 5日～2009年 2月 2日	13.2%
第16計算期間	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	4.7%
第17計算期間	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.2%
第18計算期間	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	4.8%
第19計算期間	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	6.6%
第20計算期間	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	6.2%
第21計算期間	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	4.7%
第22計算期間	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	1.1%
第23計算期間	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	1.0%

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### 財形株投（年金・住宅財形30）

	計算期間	収益率
第14計算期間	2007年 2月 2日～2008年 2月 4日	5.9%
第15計算期間	2008年 2月 5日～2009年 2月 2日	13.2%
第16計算期間	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	4.7%
第17計算期間	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	0.1%
第18計算期間	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	4.8%
第19計算期間	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	6.6%
第20計算期間	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	6.2%
第21計算期間	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	4.7%
第22計算期間	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	1.1%
第23計算期間	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	1.0%

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

#### （4）【設定及び解約の実績】

#### 財形株投（一般財形50）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数

第14計算期間	2007年 2月 2日～2008年 2月 4日	425,920,173	263,099,883	2,099,582,560
第15計算期間	2008年 2月 5日～2009年 2月 2日	484,972,398	532,033,513	2,052,521,445
第16計算期間	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	469,356,004	249,613,826	2,272,263,623
第17計算期間	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	403,974,341	236,277,550	2,439,960,414
第18計算期間	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	389,593,739	244,187,602	2,585,366,551
第19計算期間	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	363,523,445	312,349,806	2,636,540,190
第20計算期間	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	291,337,797	419,632,063	2,508,245,924
第21計算期間	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	284,161,722	270,948,707	2,521,458,939
第22計算期間	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	270,357,144	250,693,570	2,541,122,513
第23計算期間	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	307,438,772	300,599,829	2,547,961,456

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### 財形株投(一般財形30)

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第14計算期間	2007年 2月 2日～2008年 2月 4日	284,335,417	152,853,451	1,163,588,957
第15計算期間	2008年 2月 5日～2009年 2月 2日	345,500,280	166,805,720	1,342,283,517
第16計算期間	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	326,308,941	182,875,273	1,485,717,185
第17計算期間	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	307,518,975	188,028,832	1,605,207,328
第18計算期間	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	308,873,055	182,404,379	1,731,676,004
第19計算期間	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	284,798,498	209,131,493	1,807,343,009
第20計算期間	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	244,080,376	264,485,842	1,786,937,543
第21計算期間	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	264,757,216	186,225,331	1,865,469,428
第22計算期間	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	251,182,963	203,448,695	1,913,203,696
第23計算期間	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	280,770,978	179,070,816	2,014,903,858

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

#### 財形株投(年金・住宅財形30)

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第14計算期間	2007年 2月 2日～2008年 2月 4日	309,604,177	110,192,767	1,358,739,503
第15計算期間	2008年 2月 5日～2009年 2月 2日	359,000,170	151,460,101	1,566,279,572
第16計算期間	2009年 2月 3日～2010年 2月 1日	333,856,993	248,061,128	1,652,075,437
第17計算期間	2010年 2月 2日～2011年 2月 1日	319,073,642	240,949,415	1,730,199,664
第18計算期間	2011年 2月 2日～2012年 2月 1日	303,908,183	209,353,306	1,824,754,541
第19計算期間	2012年 2月 2日～2013年 2月 4日	286,444,576	153,713,010	1,957,486,107
第20計算期間	2013年 2月 5日～2014年 2月 3日	227,446,995	248,641,896	1,936,291,206
第21計算期間	2014年 2月 4日～2015年 2月 2日	233,508,374	173,394,542	1,996,405,038
第22計算期間	2015年 2月 3日～2016年 2月 1日	231,738,796	199,003,636	2,029,140,198
第23計算期間	2016年 2月 2日～2017年 2月 1日	255,348,625	190,672,770	2,093,816,053

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

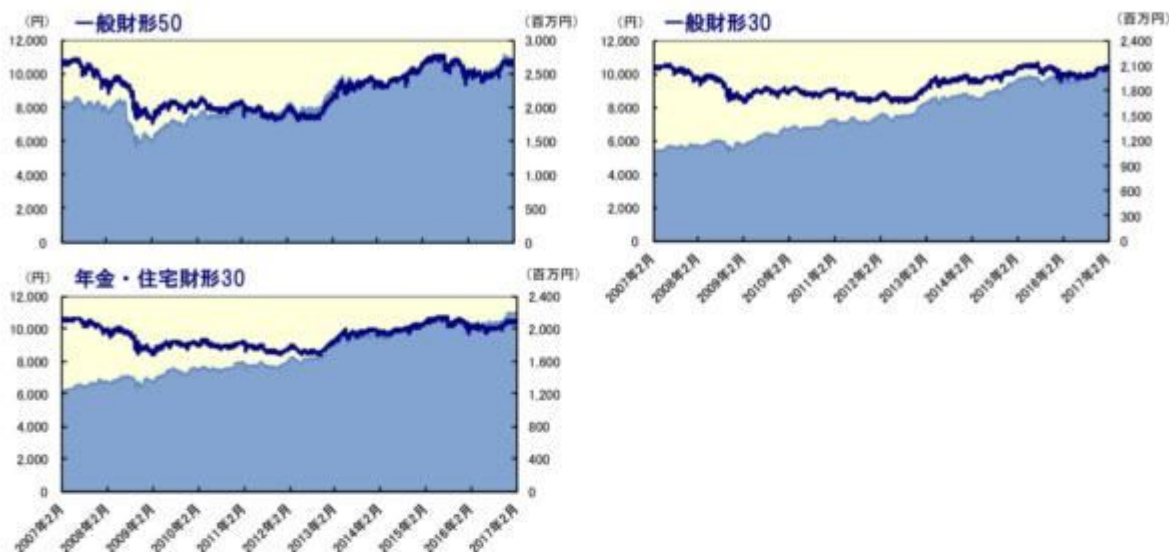
## 参考情報

## 運用実績 (2017年2月28日現在)

## 基準価額・純資産の推移

(日次)

— 基準価額(分配後、1万円あたり)(左軸)  
— 純資産総額(右軸)



## 分配の推移

(1万円あたり、課税前)

	財形株投		
	一般財形50	一般財形30	年金・住宅財形30
2017年2月	5 円	5 円	5 円
2016年2月	5 円	5 円	5 円
2015年2月	5 円	5 円	5 円
2014年2月	5 円	5 円	5 円
2013年2月	5 円	5 円	5 円
設定来累計	110 円	110 円	110 円

## 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

銘柄	投資比率(%)		
	財形株投		
	一般財形50	一般財形30	年金・住宅財形30
財形公社債マザーファンド	48.2	68.3	68.3
財形株式マザーファンド	49.5	29.4	29.2

## 実質的な銘柄別投資比率(上位)

・「財形公社債マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)		
			財形株投		
			一般財形50	一般財形30	年金・住宅財形30
1	国庫債券 利付(10年)第341回	国債証券	3.5	5.0	5.0
2	国庫債券 利付(5年)第123回	国債証券	1.8	2.6	2.6
3	共同発行市場地方債 公募第76回	地方債証券	1.4	2.0	2.0
4	国庫債券 利付(10年)第334回	国債証券	1.3	1.9	1.9
5	日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第7回	特殊債券	1.3	1.9	1.9
6	三菱東京UFJ銀行 第9回特定社債間限定同順位特約付	社債券	1.2	1.7	1.7
7	地方公共団体金融機構債券 第21回	特殊債券	1.2	1.7	1.7
8	関西国際空港社債 財投機関債第38回	特殊債券	1.2	1.7	1.7
9	中日本高速道路社債 第33回	特殊債券	1.2	1.7	1.7
10	北海道 公募平成21年度第14回	地方債証券	1.2	1.7	1.7

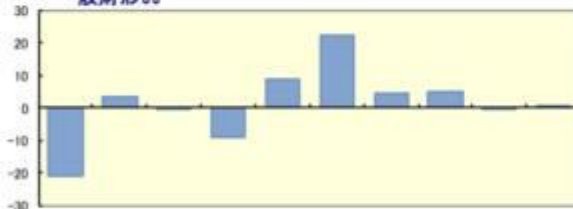
・「財形株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)		
			財形株投		
			一般財形50	一般財形30	年金・住宅財形30
1	トヨタ自動車	輸送用機器	1.7	1.0	1.0
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.2	0.7	0.7
3	日本電信電話	情報・通信業	0.8	0.5	0.5
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.8	0.5	0.5
5	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	0.8	0.4	0.4
6	本田技研工業	輸送用機器	0.7	0.4	0.4
7	KDDI	情報・通信業	0.6	0.4	0.4
8	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	0.6	0.4	0.4
9	ソニー	電気機器	0.5	0.3	0.3
10	日本たばこ産業	食料品	0.5	0.3	0.3

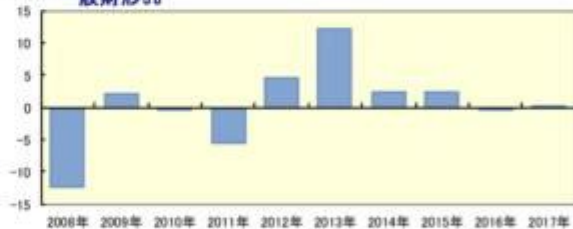
## 年間収益率の推移

(暦年ベース)

一般財形50



一般財形30



年金・住宅財形30



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2017年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。●グラフの縦軸の目盛りはファンドごとに異なる場合があります。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

申込期間中の各営業日に、有価証券届出書の「第一部 証券情報」にしたがって受益権の募集が行なわれます。

取得申込の受付は、原則として勤務先の会社・団体を通じて行うものとします。

販売会社によっては、一部のファンドのみのお取扱いとなる場合があります。

ファンドの申込（販売）手続についてご不明な点がある場合には、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

販売の単位は、1,000円以上1,000円単位（当初元本1口＝1円）とします。ただし、収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。

なお、販売会社や申込形態によっては、取得申込単位が上記と異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

受益権の販売価額は、取得申込日の基準価額とします。なお、投資者は、販売会社との間で「財形貯蓄に関する契約」を締結し、当該契約で定める日（毎月10日と20日と月末を締切日とし、各締切日から起算して5営業日目）を取得申込日として申込みを行なうものとします。

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、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込みの受付を中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消す場合があります。

< 申込手数料 >

なし

取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設された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係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、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係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。委託者は、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、委託者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。受託者は、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係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】

#### (a) 信託の一部解約（解約請求制）

受益者は、委託者に1口単位または1円単位をもって一部解約の実行を請求することができます。

換金のお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社によっては上記と異なる場合があります。

す。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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。

解約代金は、原則として解約申込みの受付日から起算して4営業日目から販売会社において支払います。

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、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

また、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、受益者は当該受け付け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、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとします。

換金価額は、解約申込みの受付日の基準価額となります。

#### (b)受益権の買取り(買取請求制)

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

受益権の買取価額は買取申込みの受付日の基準価額とします。

ただし、受益権の管理方法等の一定の要件下では上記の買取価額が適用とならない場合があります。

また、買取価額と取得価額との差額については譲渡所得の取り扱いとなります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

買取代金は、原則として買取申込みの受付日から起算して4営業日目から販売会社において支払います。

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、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、販売会社は、信託約款の規定に従い、委託者と協議のうえ、受益権の買取りを中止すること、および既に受け付けた受益権の買取りを取り消す場合があります。

また、受益権の買取りが中止された場合には、受益者は買取り中止以前に行なった当日の買取り請求を撤回できます。ただし、受益者がその買取り請求を撤回しない場合には、当該受益権の買取価額は、買取り中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に買取申込みを受け付けたものとします。

上記(a)及び(b)の詳細については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

換金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係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係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】

##### < 基準価額の計算方法 >

基準価額とは、計算日において、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または一部償却原価法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（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 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） 価格情報会社の提供する価額

残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法（アキュムレーションまたはアモチゼーション）による評価を適用することができます。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

#### (2)【保管】

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

無期限とします（平成6年2月4日設定）。

#### (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。

なお、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

のとき、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、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間は、下記「(5)その他(a)ファンドの繰上償還条項 等」による解約の日までとします。

## (5)【その他】

### (a) ファンドの繰上償還条項

委託者は、この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、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させる場合があります。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

### (b) 信託期間の終了

- ( )委託者は、上記「(a)ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、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この信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係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。
- ( )上記( )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者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。
- ( )上記( )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二分の一を超えるときは、上記(a)の信託契約の解約をしません。
- ( )委託者は、この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この信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係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。
- ( )上記( )から( )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、上記( )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うことが困難な場合には適用しません。
- ( )委託者は、監督官庁よりこの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。
- ( )委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(d)信託約款の変更( )」に該当する場合を除き、当該委託者と受託者との間において存続します。
- ( )受託者が委託者の承諾を受けてその任務を辞任する場合、または、委託者または受益者が裁判所に受託者の解任を請求し裁判所が受託者を解任した場合、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

### (c) 運用報告書

委託者は、ファンドの決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、知られたる受益者に対して交付します。

### (d) 信託約款の変更

- ( )委託者は、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、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする

する旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- ( ) 委託者は、上記( )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この信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係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。
- ( ) 上記( )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者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。
- ( ) 上記( )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二分の一を超えるときは、上記( )の信託約款の変更をしません。
- ( ) 委託者は、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、全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。
- ( ) 委託者は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記( )から( )までの規定にしたがいます。

(e) 公告

委託者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.nomura-am.co.jp/>

なお、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。

(f) 反対者の買取請求権

ファンドの信託契約の解約または信託約款の変更を行なう場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續に関する事項は、前述の「(b)信託期間の終了」( )または「(d)信託約款の変更」( )に規定する公告または書面に付記します。

(g) 関係法人との契約の更新に関する手續

委託者と販売会社との間で締結する「募集・販売等に関する契約」は、契約終了の3ヵ月前までに当事者の一方から別段の意思表示のないときは、原則1年毎に自動的に更新されるものとします。

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りである。

##### 収益分配金に対する請求権

###### 収益分配金の支払い開始日

収益分配金は、税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日（決算日）の基準価額とします。

なお、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。

##### 償還金に対する請求権

###### 償還金の支払い開始日

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ます。)に、原則として償還日(償還日が休業日の場合は翌営業日)から起算して5営業日までに支払いを開始します。

#### 償還金請求権の失効

受益者が、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

#### 換金(解約)請求権

##### 換金(解約)の単位

受益者は、受益権を1口単位または1円単位で換金できます。

換金のお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

##### 換金(解約)代金の支払い開始日

一部解約金は、受益者の解約申込みの受付日から起算して、原則として、4営業日目から受益者にお支払いします。

### 第3【ファンドの経理状況】

財形株投（一般財形50）

財形株投（一般財形30）

財形株投（年金・住宅財形30）

(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)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第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)(以下「投資信託財産計算規則」という。)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、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【財形株投（一般財形50）】

## （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	84,271,046	77,077,997
親投資信託受益証券	2,573,692,853	2,639,607,393
未収入金	500,000	12,300,000
未収利息	138	-
流動資産合計	2,658,464,037	2,728,985,390
資産合計	2,658,464,037	2,728,985,390
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	1,270,561	1,273,980
未払解約金	30,134	334,760
未払受託者報酬	712,228	711,393
未払委託者報酬	20,227,228	20,203,526
未払利息	-	152
その他未払費用	42,674	42,625
流動負債合計	22,282,825	22,566,436
負債合計	22,282,825	22,566,436
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,541,122,513	2,547,961,456
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	95,058,699	158,457,498
（分配準備積立金）	362,569,897	393,639,202
元本等合計	2,636,181,212	2,706,418,954
純資産合計	2,636,181,212	2,706,418,954
負債純資産合計	2,658,464,037	2,728,985,390

## （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
営業収益				
受取利息		45,534		801
有価証券売買等損益		98,612,349		108,174,540
営業収益合計		98,657,883		108,175,341
営業費用				
支払利息		-		49,807
受託者報酬		1,435,457		1,384,512
委託者報酬		40,766,836		39,319,918
その他費用		86,012		82,953
営業費用合計		42,288,305		40,837,190
営業利益又は営業損失（ ）		56,369,578		67,338,151
経常利益又は経常損失（ ）		56,369,578		67,338,151
当期純利益又は当期純損失（ ）		56,369,578		67,338,151
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（ ）		13,412,517		5,391,840
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		39,862,861		95,058,699
剰余金増加額又は欠損金減少額		17,990,402		2,472,778
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		17,990,402		2,472,778
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,481,064		10,529,990
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,481,064		10,529,990
分配金		1,270,561		1,273,980
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		95,058,699		158,457,498

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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よった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成28年 2月 2日から平成29年 2月 1日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

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
1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,541,122,513口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,547,961,456口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0374円 (10,000口当たり純資産額) (10,374円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0622円 (10,000口当たり純資産額) (10,622円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	第23期 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	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>18,264,336円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>24,692,725円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>575,541,531円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>320,883,397円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>939,381,989円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,541,122,513口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>3,696円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>1,270,561円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	18,264,336円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	24,692,725円	収益調整金額	C	575,541,531円	分配準備積立金額	D	320,883,397円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	939,381,989円	当ファンドの期末残存口数	F	2,541,122,513口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,696円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,270,561円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>24,758,137円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>47,971,854円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>618,833,187円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>322,183,191円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>1,013,746,369円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,547,961,456口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>3,978円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>1,273,980円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	24,758,137円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	47,971,854円	収益調整金額	C	618,833,187円	分配準備積立金額	D	322,183,191円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,013,746,369円	当ファンドの期末残存口数	F	2,547,961,456口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,978円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,273,980円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	18,264,336円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	24,692,725円																																																											
収益調整金額	C	575,541,531円																																																											
分配準備積立金額	D	320,883,397円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	939,381,989円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,541,122,513口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,696円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,270,561円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	24,758,137円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	47,971,854円																																																											
収益調整金額	C	618,833,187円																																																											
分配準備積立金額	D	322,183,191円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,013,746,369円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,547,961,456口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	3,978円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,273,980円																																																											
	2. 追加情報																																																												



	平成28年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。
--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	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> <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、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

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
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	2. 時価の算定方法 同左

## （関連当事者との取引に関する注記）

第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	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公正な価格を勘案して、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、該当事項はございません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	第23期 自 平成28年 2月 2日 至 平成29年 2月 1日
期首元本額 2,521,458,939円	期首元本額 2,541,122,513円
期中追加設定元本額 270,357,144円	期中追加設定元本額 307,438,772円
期中一部解約元本額 250,693,570円	期中一部解約元本額 300,599,829円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	第23期 自 平成28年 2月 2日 至 平成29年 2月 1日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	71,933,530	111,966,595
合計	71,933,530	111,966,595

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(平成29年 2月 1日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(平成29年 2月 1日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	財形株式マザーファンド	988,425,168	1,338,624,205	
		財形公社債マザーファンド	945,275,876	1,300,983,188	
	小計	銘柄数：2 組入時価比率：97.5%	1,933,701,044	2,639,607,393 100.0%	
合計				2,639,607,393	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 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	62,241,805	66,779,747
親投資信託受益証券	1,900,555,452	2,019,048,564
未収入金	600,000	1,000,000
未収利息	102	-
流動資産合計	1,963,397,359	2,086,828,311
資産合計	1,963,397,359	2,086,828,311
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	956,601	1,007,451
未払解約金	1,019,684	-
未払受託者報酬	518,233	542,819
未払委託者報酬	14,717,974	15,415,872
未払利息	-	131
その他未払費用	31,035	32,515
流動負債合計	17,243,527	16,998,788
負債合計	17,243,527	16,998,788
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,913,203,696	2,014,903,858
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	32,950,136	54,925,665
（分配準備積立金）	143,250,759	155,776,167
元本等合計	1,946,153,832	2,069,829,523
純資産合計	1,946,153,832	2,069,829,523
負債純資産合計	1,963,397,359	2,086,828,311

## （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
営業収益				
受取利息		33,355		673
有価証券売買等損益		51,356,318		54,378,112
営業収益合計		51,389,673		54,378,785
営業費用				
支払利息		-		38,665
受託者報酬		1,040,193		1,056,115
委託者報酬		29,541,730		29,993,380
その他費用		62,288		63,250
営業費用合計		30,644,211		31,151,410
営業利益又は営業損失（ ）		20,745,462		23,227,375
経常利益又は経常損失（ ）		20,745,462		23,227,375
当期純利益又は当期純損失（ ）		20,745,462		23,227,375
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（ ）		6,305,890		2,843,563
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		12,534,141		32,950,136
剰余金増加額又は欠損金減少額		8,619,894		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		8,619,894		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,686,870		3,087,958
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,686,870		2,773,615
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		314,343
分配金		956,601		1,007,451
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		32,950,136		54,925,665

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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よった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成28年 2月 2日から平成29年 2月 1日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

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
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,913,203,696口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,014,903,858口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0172円 (10,000口当たり純資産額) (10,172円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0273円 (10,000口当たり純資産額) (10,273円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	第23期 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	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>7,291,313円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>7,148,259円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>334,089,529円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>129,767,788円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>478,296,889円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,913,203,696口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>2,499円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>956,601円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	7,291,313円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	7,148,259円	収益調整金額	C	334,089,529円	分配準備積立金額	D	129,767,788円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	478,296,889円	当ファンドの期末残存口数	F	1,913,203,696口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,499円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	956,601円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>11,362,154円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>14,708,784円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>372,282,015円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>130,712,680円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>529,065,633円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,014,903,858口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>2,625円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>1,007,451円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	11,362,154円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	14,708,784円	収益調整金額	C	372,282,015円	分配準備積立金額	D	130,712,680円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	529,065,633円	当ファンドの期末残存口数	F	2,014,903,858口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,625円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,007,451円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	7,291,313円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	7,148,259円																																																											
収益調整金額	C	334,089,529円																																																											
分配準備積立金額	D	129,767,788円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	478,296,889円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,913,203,696口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,499円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	956,601円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	11,362,154円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	14,708,784円																																																											
収益調整金額	C	372,282,015円																																																											
分配準備積立金額	D	130,712,680円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	529,065,633円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,014,903,858口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,625円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,007,451円																																																											
	2. 追加情報																																																												

	平成28年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。
--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	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> <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、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

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
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	2. 時価の算定方法 同左

## （関連当事者との取引に関する注記）

第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	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公正な価格を勘案して、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、該当事項はございません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	第23期 自 平成28年 2月 2日 至 平成29年 2月 1日
期首元本額 1,865,469,428円	期首元本額 1,913,203,696円
期中追加設定元本額 251,182,963円	期中追加設定元本額 280,770,978円
期中一部解約元本額 203,448,695円	期中一部解約元本額 179,070,816円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	第23期 自 平成28年 2月 2日 至 平成29年 2月 1日
	損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	36,377,788	56,692,387
合計	36,377,788	56,692,387

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。



## （４）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成29年 2月 1日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成29年 2月 1日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益 証券	日本円	財形株式マザーファンド	447,175,678	605,610,020	
		財形公社債マザーファンド	1,026,984,338	1,413,438,544	
	小計	銘柄数：2 組入時価比率：97.5%	1,474,160,016	2,019,048,564 100.0%	
合計				2,019,048,564	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 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。

## 【財形株投（年金・住宅財形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	66,964,816	72,195,936
親投資信託受益証券	2,038,854,680	2,122,295,539
未収入金	500,000	-
未収利息	110	-
流動資産合計	2,106,319,606	2,194,491,475
資産合計	2,106,319,606	2,194,491,475
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	1,014,570	1,046,908
未払受託者報酬	559,647	572,720
未払委託者報酬	15,893,934	16,265,371
未払利息	-	142
その他未払費用	33,516	34,300
流動負債合計	17,501,667	17,919,441
負債合計	17,501,667	17,919,441
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,029,140,198	2,093,816,053
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	59,677,741	82,755,981
（分配準備積立金）	156,441,992	168,077,637
元本等合計	2,088,817,939	2,176,572,034
純資産合計	2,088,817,939	2,176,572,034
負債純資産合計	2,106,319,606	2,194,491,475

## （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
営業収益				
受取利息		36,108		711
有価証券売買等損益		56,009,123		56,773,859
営業収益合計		56,045,231		56,774,570
営業費用				
支払利息		-		40,858
受託者報酬		1,124,576		1,122,366
委託者報酬		31,938,083		31,875,361
その他費用		67,348		67,213
営業費用合計		33,130,007		33,105,798
営業利益又は営業損失（ ）		22,915,224		23,668,772
経常利益又は経常損失（ ）		22,915,224		23,668,772
当期純利益又は当期純損失（ ）		22,915,224		23,668,772
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（ ）		6,267,704		2,858,737
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		37,430,734		59,677,741
剰余金増加額又は欠損金減少額		10,614,304		2,907,673
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		10,614,304		2,907,673
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,000,247		5,310,034
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,000,247		5,310,034
分配金		1,014,570		1,046,908
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		59,677,741		82,755,981

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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よった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、平成28年 2月 2日から平成29年 2月 1日までとなっております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

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
1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,029,140,198口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,093,816,053口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0294円 (10,000口当たり純資産額) (10,294円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.0395円 (10,000口当たり純資産額) (10,395円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	第23期 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	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>8,241,529円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>8,405,991円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>343,569,306円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>140,809,042円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>501,025,868円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,029,140,198口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>2,469円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>1,014,570円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	8,241,529円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	8,405,991円	収益調整金額	C	343,569,306円	分配準備積立金額	D	140,809,042円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	501,025,868円	当ファンドの期末残存口数	F	2,029,140,198口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,469円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,014,570円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>11,775,281円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>14,752,228円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>373,604,746円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>142,597,036円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>542,729,291円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,093,816,053口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>2,592円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>5円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>1,046,908円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	11,775,281円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	14,752,228円	収益調整金額	C	373,604,746円	分配準備積立金額	D	142,597,036円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	542,729,291円	当ファンドの期末残存口数	F	2,093,816,053口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,592円	10,000口当たり分配金額	H	5円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,046,908円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	8,241,529円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	8,405,991円																																																											
収益調整金額	C	343,569,306円																																																											
分配準備積立金額	D	140,809,042円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	501,025,868円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,029,140,198口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,469円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,014,570円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	11,775,281円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	14,752,228円																																																											
収益調整金額	C	373,604,746円																																																											
分配準備積立金額	D	142,597,036円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	542,729,291円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,093,816,053口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,592円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	5円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,046,908円																																																											
	2. 追加情報																																																												

	平成28年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。
--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	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> <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、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

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
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （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. 時価の算定方法 同左
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

## （関連当事者との取引に関する注記）

第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	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公正な価格を勘案して、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、該当事項はございません。	同左

## （その他の注記）

## 1 元本の移動

第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	第23期 自 平成28年 2月 2日 至 平成29年 2月 1日
期首元本額 1,996,405,038円	期首元本額 2,029,140,198円
期中追加設定元本額 231,738,796円	期中追加設定元本額 255,348,625円
期中一部解約元本額 199,003,636円	期中一部解約元本額 190,672,770円

## 2 有価証券関係

## 売買目的有価証券

種類	第22期 自 平成27年 2月 3日 至 平成28年 2月 1日	第23期 自 平成28年 2月 2日 至 平成29年 2月 1日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	39,604,731	59,730,343
合計	39,604,731	59,730,343

## 3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

## （４）【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(平成29年 2月 1日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(平成29年 2月 1日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	財形株式マザーファンド	469,830,174	636,291,004	
		財形公社債マザーファンド	1,079,709,755	1,486,004,535	
	小計	銘柄数：2 組入時価比率：97.5%	1,549,539,929	2,122,295,539 100.0%	
合計				2,122,295,539	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 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）

「財形株投」の各ファンドは「財形株式マザーファンド」および「財形公社債マザーファンド」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、すべて同親投資信託の受益証券です。  
なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 財形株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(平成29年 2月 1日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	48,141,002
株式	2,526,502,298
派生商品評価勘定	964,656
未収配当金	3,605,557
差入委託証拠金	1,900,150

(平成29年 2月 1日現在)

流動資産合計	2,581,113,663
資産合計	2,581,113,663
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	277,870
未払解約金	300,000
未払利息	94
流動負債合計	577,964
負債合計	577,964
純資産の部	
元本等	
元本	1,905,431,020
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	675,104,679
元本等合計	2,580,535,699
純資産合計	2,580,535,699
負債純資産合計	2,581,113,663

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 受取配当金は、原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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よった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

(貸借対照表に関する注記)

平成29年 2月 1日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3543円
(10,000口当たり純資産額)	(13,543円)



## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

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> <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、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>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、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

平成29年 2月 1日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年 2月 1日現在	
期首	平成28年 2月 2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	1,956,018,977円

同期中における追加設定元本額	434,400,604円
同期中における一部解約元本額	484,988,561円
期末元本額	1,905,431,020円
期末元本額の内訳*	
財形株投(一般財形30)	447,175,678円
財形株投(一般財形50)	988,425,168円
財形株投(年金・住宅財形30)	469,830,174円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1)株式(平成29年 2月 1日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	100	2,735.00	273,500	
		日本水産	1,700	548.00	931,600	
		マルハニチロ	200	3,125.00	625,000	
		サカタのタネ	200	3,275.00	655,000	
		ホクト	100	2,046.00	204,600	
		住石ホールディングス	400	97.00	38,800	
		三井松島産業	100	1,386.00	138,600	
		国際石油開発帝石	6,700	1,113.00	7,457,100	
		石油資源開発	300	2,551.00	765,300	
		K&Oエナジーグループ	100	1,774.00	177,400	
		ショーボンドホールディングス	100	4,865.00	486,500	
		ミライト・ホールディングス	400	1,050.00	420,000	
		タマホーム	100	549.00	54,900	
		サンヨーホームズ	100	655.00	65,500	
		ダイセキ環境ソリューション	100	1,641.00	164,100	
		安藤・間	900	799.00	719,100	
		東急建設	500	898.00	449,000	
		コムシスホールディングス	500	2,076.00	1,038,000	
		ミサワホーム	200	1,128.00	225,600	
		ピーアールホールディングス	200	294.00	58,800	
高松コンストラクショングループ	100	2,545.00	254,500			

東建コーポレーション	100	8,160.00	816,000	
ヤマウラ	100	581.00	58,100	
大成建設	7,000	806.00	5,642,000	
大林組	3,800	1,087.00	4,130,600	
清水建設	4,000	1,046.00	4,184,000	
飛島建設	1,200	178.00	213,600	
長谷工コーポレーション	1,500	1,256.00	1,884,000	
松井建設	100	1,088.00	108,800	
鹿島建設	6,000	784.00	4,704,000	
不動テトラ	1,000	210.00	210,000	
大末建設	100	981.00	98,100	
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	4,900	122.00	597,800	
前田建設工業	1,000	1,007.00	1,007,000	
佐田建設	100	437.00	43,700	
ナカノフドー建設	100	573.00	57,300	
奥村組	1,000	687.00	687,000	
東鉄工業	200	3,335.00	667,000	
イチケン	1,000	466.00	466,000	
戸田建設	1,000	627.00	627,000	
熊谷組	2,000	321.00	642,000	
青木あすなろ建設	100	784.00	78,400	
植木組	1,000	254.00	254,000	
矢作建設工業	200	1,071.00	214,200	
ピーエス三菱	200	379.00	75,800	
日本ハウスホールディングス	300	515.00	154,500	
大東建託	500	15,920.00	7,960,000	
新日本建設	200	886.00	177,200	
東亜建設工業	100	1,815.00	181,500	
若築建設	1,000	151.00	151,000	
東洋建設	400	408.00	163,200	
五洋建設	1,400	558.00	781,200	
大林道路	100	676.00	67,600	
世紀東急工業	200	495.00	99,000	
住友林業	900	1,631.00	1,467,900	

日本基礎技術	200	346.00	69,200
ヤマダ・エスバイエルホーム	1,000	79.00	79,000
巴コーポレーション	200	361.00	72,200
大和ハウス工業	3,700	3,048.00	11,277,600
ライト工業	200	1,232.00	246,400
積水ハウス	4,000	1,842.50	7,370,000
日特建設	200	455.00	91,000
北陸電気工事	100	887.00	88,700
西部電気工業	100	2,263.00	226,300
中電工	200	2,374.00	474,800
関電工	1,000	964.00	964,000
きんでん	900	1,471.00	1,323,900
住友電設	100	1,265.00	126,500
日本電設工業	200	2,071.00	414,200
協和エクシオ	500	1,669.00	834,500
新日本空調	100	1,275.00	127,500
N D S	100	2,885.00	288,500
九電工	200	2,999.00	599,800
三機工業	300	980.00	294,000
日揮	1,200	1,963.00	2,355,600
中外炉工業	1,000	224.00	224,000
ヤマト	100	540.00	54,000
高砂熱学工業	300	1,572.00	471,600
三晃金属工業	100	3,175.00	317,500
明星工業	200	625.00	125,000
大気社	200	2,860.00	572,000
日比谷総合設備	100	1,705.00	170,500
東芝プラントシステム	200	1,704.00	340,800
O S J Bホールディングス	400	247.00	98,800
東洋エンジニアリング	1,000	301.00	301,000
千代田化工建設	1,000	764.00	764,000
新興プランテック	300	806.00	241,800
日本製粉	400	1,615.00	646,000
日清製粉グループ本社	1,400	1,715.00	2,401,000
昭和産業	1,000	597.00	597,000
鳥越製粉	100	786.00	78,600

中部飼料	100	1,091.00	109,100
フィード・ワン	800	174.00	139,200
日本甜菜製糖	100	2,325.00	232,500
三井製糖	100	2,591.00	259,100
塩水港精糖	100	248.00	24,800
日新製糖	100	1,690.00	169,000
森永製菓	200	4,985.00	997,000
江崎グリコ	300	5,290.00	1,587,000
名糖産業	100	1,397.00	139,700
不二家	1,000	229.00	229,000
山崎製パン	900	2,295.00	2,065,500
亀田製菓	100	5,340.00	534,000
寿スピリッツ	100	2,772.00	277,200
カルビー	500	3,535.00	1,767,500
森永乳業	1,000	792.00	792,000
六甲バター	100	2,435.00	243,500
ヤクルト本社	700	6,070.00	4,249,000
明治ホールディングス	700	8,820.00	6,174,000
雪印メグミルク	300	2,973.00	891,900
プリマハム	1,000	443.00	443,000
日本ハム	1,000	3,075.00	3,075,000
丸大食品	1,000	492.00	492,000
S F o o d s	100	3,115.00	311,500
伊藤ハム米久ホールディングス	700	1,015.00	710,500
サッポロホールディングス	400	2,935.00	1,174,000
アサヒグループホールディングス	2,400	3,972.00	9,532,800
キリンホールディングス	5,400	1,865.50	10,073,700
宝ホールディングス	900	1,045.00	940,500
コカ・コーラウエスト	400	3,300.00	1,320,000
コカ・コーライーストジャパン	500	2,475.00	1,237,500
サントリー食品インターナショナル	900	4,820.00	4,338,000
ダイドーグループホールディングス	100	5,920.00	592,000
伊藤園	400	3,800.00	1,520,000
キーコーヒー	100	2,109.00	210,900
日清オイリオグループ	1,000	538.00	538,000
不二製油グループ本社	300	2,274.00	682,200

J - オイルミルズ	100	4,040.00	404,000
キッコーマン	1,000	3,630.00	3,630,000
味の素	2,600	2,305.00	5,993,000
キューピー	600	2,866.00	1,719,600
ハウス食品グループ本社	500	2,474.00	1,237,000
カゴメ	500	2,934.00	1,467,000
焼津水産化学工業	100	1,216.00	121,600
アリアケジャパン	100	5,900.00	590,000
ニチレイ	600	2,327.00	1,396,200
東洋水産	600	4,045.00	2,427,000
日清食品ホールディングス	500	6,020.00	3,010,000
フジッコ	100	2,531.00	253,100
ロック・フィールド	100	1,644.00	164,400
日本たばこ産業	7,000	3,631.00	25,417,000
わらべや日洋ホールディングス	100	2,492.00	249,200
なとり	100	1,827.00	182,700
ユーグレナ	400	1,180.00	472,000
片倉工業	100	1,335.00	133,500
ゲンゼ	1,000	392.00	392,000
東洋紡	4,000	186.00	744,000
ユニチカ	3,000	80.00	240,000
倉敷紡績	1,000	233.00	233,000
シキボウ	1,000	155.00	155,000
日本毛織	300	903.00	270,900
トーア紡コーポレーション	100	549.00	54,900
ダイドーリミテッド	100	439.00	43,900
帝国繊維	100	1,523.00	152,300
帝人	1,000	2,417.00	2,417,000
東レ	9,000	988.70	8,898,300
日本フェルト	100	511.00	51,100
アツギ	1,000	126.00	126,000
セーレン	200	1,415.00	283,000
小松精練	200	725.00	145,000
ワコールホールディングス	1,000	1,425.00	1,425,000
ホギメディカル	100	7,050.00	705,000
レナウン	300	116.00	34,800

T S I ホールディングス	400	822.00	328,800
三陽商会	1,000	167.00	167,000
オンワードホールディングス	1,000	841.00	841,000
キムラタン	5,000	7.00	35,000
デサント	200	1,299.00	259,800
キング	100	410.00	41,000
ヤマトインターナショナル	100	409.00	40,900
特種東海製紙	100	4,025.00	402,500
王子ホールディングス	5,000	505.00	2,525,000
日本製紙	500	2,070.00	1,035,000
三菱製紙	200	809.00	161,800
北越紀州製紙	700	689.00	482,300
大王製紙	500	1,280.00	640,000
レンゴー	1,100	693.00	762,300
ザ・バック	100	2,968.00	296,800
クラレ	2,000	1,809.00	3,618,000
旭化成	7,000	1,052.00	7,364,000
共和レザー	100	894.00	89,400
昭和電工	800	1,866.00	1,492,800
住友化学	9,000	605.00	5,445,000
日産化学工業	700	4,100.00	2,870,000
ラサ工業	1,000	138.00	138,000
クレハ	100	4,810.00	481,000
石原産業	200	929.00	185,800
日東エフシー	100	932.00	93,200
日本曹達	1,000	546.00	546,000
東ソー	3,000	865.00	2,595,000
トクヤマ	2,000	543.00	1,086,000
セントラル硝子	1,000	552.00	552,000
東亜合成	700	1,216.00	851,200
大阪ソーダ	1,000	498.00	498,000
デンカ	3,000	559.00	1,677,000
信越化学工業	2,100	9,766.00	20,508,600
日本カーバイド工業	1,000	151.00	151,000
堺化学工業	1,000	401.00	401,000
エア・ウォーター	1,000	2,092.00	2,092,000

大陽日酸	1,000	1,346.00	1,346,000
日本パーカラライジング	600	1,411.00	846,600
高圧ガス工業	200	741.00	148,200
ステラ ケミファ	100	3,485.00	348,500
日本触媒	200	7,820.00	1,564,000
カネカ	2,000	983.00	1,966,000
三菱瓦斯化学	1,200	2,183.00	2,619,600
三井化学	5,000	544.00	2,720,000
J S R	1,200	1,981.00	2,377,200
東京応化工業	200	3,990.00	798,000
大阪有機化学工業	100	911.00	91,100
三菱ケミカルホールディングス	8,000	798.80	6,390,400
K H ネオケム	100	1,375.00	137,500
ダイセル	1,700	1,258.00	2,138,600
住友ベークライト	1,000	665.00	665,000
積水化学工業	2,700	1,886.00	5,092,200
日本ゼオン	1,000	1,312.00	1,312,000
アイカ工業	400	3,020.00	1,208,000
宇部興産	6,000	274.00	1,644,000
積水樹脂	200	1,803.00	360,600
日立化成	700	3,240.00	2,268,000
リケンテクノス	300	551.00	165,300
積水化成成品工業	200	813.00	162,600
タイガースポリマー	100	819.00	81,900
ミライアル	100	963.00	96,300
ダイキアクシス	100	1,142.00	114,200
ダイキョーニシカワ	200	1,467.00	293,400
日本化薬	1,000	1,555.00	1,555,000
カーリットホールディングス	200	558.00	111,600
日本精化	100	901.00	90,100
扶桑化学工業	100	2,539.00	253,900
A D E K A	500	1,645.00	822,500
日油	1,000	1,196.00	1,196,000
新日本理化	200	157.00	31,400
ハリマ化成グループ	200	782.00	156,400
花王	3,000	5,624.00	16,872,000



三洋化成工業	100	4,905.00	490,500
有機合成薬品工業	100	273.00	27,300
大日本塗料	1,000	239.00	239,000
日本ペイントホールディングス	1,000	3,330.00	3,330,000
関西ペイント	1,300	2,346.00	3,049,800
中国塗料	300	818.00	245,400
日本特殊塗料	100	1,783.00	178,300
藤倉化成	200	666.00	133,200
太陽ホールディングス	100	4,650.00	465,000
D I C	500	3,535.00	1,767,500
サカタインクス	200	1,484.00	296,800
東洋インキ S C ホールディングス	1,000	560.00	560,000
T & K T O K A	100	1,041.00	104,100
富士フイルムホールディングス	2,300	4,161.00	9,570,300
資生堂	2,300	3,168.00	7,286,400
ライオン	1,000	1,994.00	1,994,000
高砂香料工業	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
ファンケル	300	1,561.00	468,300
コーセー	200	9,460.00	1,892,000
コタ	100	1,352.00	135,200
シーズ・ホールディングス	200	3,245.00	649,000
ポーラ・オルビスホールディングス	100	10,740.00	1,074,000
ノエビアホールディングス	100	3,960.00	396,000
アジュバンコスメジャパン	100	957.00	95,700
エステー	100	1,759.00	175,900
アグロ カネショウ	100	1,253.00	125,300
コニシ	200	1,347.00	269,400
長谷川香料	200	1,989.00	397,800
星光 P M C	100	1,199.00	119,900
小林製薬	300	5,080.00	1,524,000
荒川化学工業	100	1,885.00	188,500
メック	100	1,021.00	102,100
タカラバイオ	300	1,586.00	475,800
新田ゼラチン	100	755.00	75,500

デクセリアルズ	300	1,223.00	366,900
アース製薬	100	4,870.00	487,000
イハラケミカル工業	200	1,051.00	210,200
クミアイ化学工業	200	664.00	132,800
日本農薬	300	620.00	186,000
アキレス	100	1,675.00	167,500
有沢製作所	200	680.00	136,000
日東電工	900	9,450.00	8,505,000
きもと	300	238.00	71,400
藤森工業	100	2,960.00	296,000
前澤化成工業	100	1,181.00	118,100
J S P	100	2,575.00	257,500
エフピコ	100	5,390.00	539,000
天馬	100	2,099.00	209,900
信越ポリマー	200	846.00	169,200
東リ	300	400.00	120,000
ニフコ	200	5,770.00	1,154,000
日本バルカー工業	100	1,825.00	182,500
ユニ・チャーム	2,400	2,564.50	6,154,800
協和発酵キリン	1,500	1,581.00	2,371,500
武田薬品工業	4,400	4,768.00	20,979,200
アステラス製薬	12,100	1,465.00	17,726,500
大日本住友製薬	800	1,907.00	1,525,600
塩野義製薬	1,600	5,443.00	8,708,800
田辺三菱製薬	1,400	2,281.00	3,193,400
わかもと製薬	1,000	247.00	247,000
あすか製薬	100	1,738.00	173,800
日本新薬	300	5,460.00	1,638,000
中外製薬	1,200	3,405.00	4,086,000
科研製薬	200	5,730.00	1,146,000
エーザイ	1,500	6,228.00	9,342,000
ロート製薬	600	1,973.00	1,183,800
小野薬品工業	2,600	2,354.50	6,121,700
久光製薬	300	5,930.00	1,779,000
持田製薬	100	8,140.00	814,000
参天製薬	2,200	1,447.00	3,183,400

ツムラ	400	3,275.00	1,310,000
日医工	300	1,619.00	485,700
キッセイ薬品工業	200	2,750.00	550,000
生化学工業	200	1,667.00	333,400
栄研化学	100	2,948.00	294,800
日水製薬	100	1,305.00	130,500
鳥居薬品	100	2,512.00	251,200
J C R ファーマ	100	2,655.00	265,500
東和薬品	100	4,355.00	435,500
沢井製薬	200	5,840.00	1,168,000
ゼリア新薬工業	200	1,773.00	354,600
第一三共	3,400	2,560.50	8,705,700
キョーリン製薬ホールディングス	300	2,473.00	741,900
大幸薬品	100	1,804.00	180,400
ダイト	100	2,226.00	222,600
大塚ホールディングス	2,500	5,236.00	13,090,000
大正製薬ホールディングス	300	9,610.00	2,883,000
ペプチドリーム	200	5,680.00	1,136,000
日本コークス工業	1,000	110.00	110,000
昭和シェル石油	1,000	1,106.00	1,106,000
ニチレキ	100	924.00	92,400
東燃ゼネラル石油	2,000	1,333.00	2,666,000
ユシロ化学工業	100	1,451.00	145,100
富士石油	300	399.00	119,700
出光興産	600	3,580.00	2,148,000
J X ホールディングス	13,100	531.90	6,967,890
コスモエネルギーホールディングス	400	1,929.00	771,600
横浜ゴム	800	1,991.00	1,592,800
東洋ゴム工業	700	1,346.00	942,200
ブリヂストン	4,000	4,153.00	16,612,000
住友ゴム工業	1,200	1,777.00	2,132,400
藤倉ゴム工業	100	661.00	66,100
フコク	100	918.00	91,800
ニッタ	200	3,085.00	617,000
住友理工	200	1,161.00	232,200
バンドー化学	200	1,006.00	201,200

日東紡績	1,000	461.00	461,000
旭硝子	6,000	845.00	5,070,000
日本板硝子	500	932.00	466,000
日本電気硝子	2,000	656.00	1,312,000
オハラ	100	885.00	88,500
住友大阪セメント	2,000	456.00	912,000
太平洋セメント	7,000	398.00	2,786,000
日本ヒューム	100	703.00	70,300
日本コンクリート工業	300	341.00	102,300
三谷セキサン	100	2,931.00	293,100
アジアパイルホールディングス	100	578.00	57,800
東海カーボン	1,100	415.00	456,500
日本カーボン	1,000	287.00	287,000
東洋炭素	100	1,928.00	192,800
ノリタケカンパニーリミテド	100	2,910.00	291,000
TOTO	900	4,345.00	3,910,500
日本碍子	1,400	2,330.00	3,262,000
日本特殊陶業	1,000	2,566.00	2,566,000
イソライト工業	100	341.00	34,100
東京窯業	200	195.00	39,000
フジインコーポレーテッド	100	2,612.00	261,200
ニチアス	1,000	1,163.00	1,163,000
ニチハ	200	3,000.00	600,000
新日鐵住金	5,300	2,794.50	14,810,850
神戸製鋼所	2,100	1,117.00	2,345,700
中山製鋼所	100	768.00	76,800
合同製鐵	100	1,900.00	190,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	3,200	2,066.50	6,612,800
日新製鋼	500	1,534.00	767,000
東京製鐵	600	1,037.00	622,200
共英製鋼	100	2,310.00	231,000
大和工業	200	3,305.00	661,000
大阪製鐵	100	2,142.00	214,200
淀川製鋼所	200	3,310.00	662,000
東洋鋼鈹	300	411.00	123,300

丸一鋼管	400	3,845.00	1,538,000
大同特殊鋼	2,000	579.00	1,158,000
日本冶金工業	1,000	192.00	192,000
山陽特殊製鋼	1,000	626.00	626,000
愛知製鋼	100	4,980.00	498,000
日立金属	1,200	1,582.00	1,898,400
大平洋金属	1,000	358.00	358,000
新日本電工	700	320.00	224,000
栗本鐵工所	100	2,397.00	239,700
三菱製鋼	1,000	256.00	256,000
日亜鋼業	200	281.00	56,200
シンニッタン	100	704.00	70,400
日本軽金属ホールディングス	2,700	278.00	750,600
三井金属鉱業	3,000	315.00	945,000
東邦亜鉛	1,000	499.00	499,000
三菱マテリアル	700	3,875.00	2,712,500
住友金属鉱山	3,000	1,552.00	4,656,000
DOWAホールディングス	1,000	963.00	963,000
古河機械金属	2,000	223.00	446,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	100	1,852.00	185,200
東邦チタニウム	200	918.00	183,600
UACJ	2,000	362.00	724,000
古河電気工業	400	3,850.00	1,540,000
住友電気工業	4,500	1,670.00	7,515,000
フジクラ	1,600	720.00	1,152,000
昭和電線ホールディングス	1,000	90.00	90,000
タツタ電線	200	468.00	93,600
沖電線	1,000	246.00	246,000
平河ヒューテック	100	1,334.00	133,400
リョービ	1,000	494.00	494,000
アーレスティ	100	1,205.00	120,500
アサヒホールディングス	200	2,275.00	455,000
稲葉製作所	100	1,312.00	131,200
宮地エンジニアリンググループ	1,000	197.00	197,000
トーカロ	100	2,764.00	276,400
SUMCO	1,200	1,780.00	2,136,000

東洋製罐グループホールディングス	800	2,101.00	1,680,800
コロナ	100	1,150.00	115,000
横河ブリッジホールディングス	200	1,491.00	298,200
三和ホールディングス	1,200	1,057.00	1,268,400
文化シャッター	300	908.00	272,400
三協立山	100	1,754.00	175,400
アルインコ	100	1,049.00	104,900
LIxilグループ	1,700	2,651.00	4,506,700
日本フィルコン	100	574.00	57,400
ノーリツ	200	1,990.00	398,000
長府製作所	100	2,593.00	259,300
リンナイ	200	9,630.00	1,926,000
ダイニチ工業	100	735.00	73,500
日東精工	200	410.00	82,000
三洋工業	1,000	197.00	197,000
岡部	200	963.00	192,600
ジーテクト	100	2,136.00	213,600
中国工業	100	697.00	69,700
東プレ	200	2,876.00	575,200
高周波熱錬	200	909.00	181,800
東京製綱	100	1,935.00	193,500
サンコール	100	540.00	54,000
モリテック スチール	100	292.00	29,200
パイオラックス	100	7,270.00	727,000
日本発條	1,100	1,149.00	1,263,900
立川ブラインド工業	100	918.00	91,800
三益半導体工業	100	1,838.00	183,800
日本ドライケミカル	100	2,360.00	236,000
日本製鋼所	400	2,136.00	854,400
三浦工業	500	1,802.00	901,000
タクマ	400	996.00	398,400
オークマ	1,000	1,178.00	1,178,000
東芝機械	1,000	499.00	499,000
アマダホールディングス	1,600	1,335.00	2,136,000
アイダエンジニアリング	300	1,117.00	335,100
滝澤鉄工所	1,000	170.00	170,000

富士機械製造	400	1,445.00	578,000
牧野フライス製作所	1,000	1,014.00	1,014,000
オーエスジー	500	2,373.00	1,186,500
旭ダイヤモンド工業	300	851.00	255,300
D M G 森精機	700	1,550.00	1,085,000
ソディック	300	1,003.00	300,900
ディスコ	100	14,280.00	1,428,000
日東工器	100	2,519.00	251,900
パンチ工業	100	959.00	95,900
豊和工業	100	724.00	72,400
O K K	1,000	126.00	126,000
東洋機械金属	100	545.00	54,500
エンシュウ	1,000	101.00	101,000
島精機製作所	200	3,635.00	727,000
日阪製作所	200	948.00	189,600
やまびこ	200	1,590.00	318,000
ベガサスミシン製造	100	774.00	77,400
ナブテスコ	600	2,954.00	1,772,400
三井海洋開発	100	1,880.00	188,000
レオン自動機	100	1,121.00	112,100
S M C	400	31,410.00	12,564,000
新川	100	855.00	85,500
ユニオンツール	100	3,140.00	314,000
オイレス工業	200	2,035.00	407,000
サトーホールディングス	100	2,442.00	244,200
日本エアーテック	100	638.00	63,800
日精樹脂工業	100	1,031.00	103,100
ワイエイシイ	100	1,586.00	158,600
小松製作所	5,400	2,775.00	14,985,000
住友重機械工業	3,000	801.00	2,403,000
日立建機	500	2,638.00	1,319,000
井関農機	1,000	226.00	226,000
T O W A	100	1,640.00	164,000
丸山製作所	1,000	191.00	191,000
北川鉄工所	100	2,433.00	243,300
クボタ	5,600	1,824.50	10,217,200

荏原実業	100	1,345.00	134,500
月島機械	200	1,266.00	253,200
帝国電機製作所	100	1,022.00	102,200
東京機械製作所	1,000	76.00	76,000
新東工業	300	1,028.00	308,400
澁谷工業	100	2,334.00	233,400
アイチ コーポレーション	200	851.00	170,200
小森コーポレーション	300	1,557.00	467,100
鶴見製作所	100	1,530.00	153,000
住友精密工業	1,000	353.00	353,000
荏原製作所	500	3,500.00	1,750,000
西島製作所	100	1,133.00	113,300
北越工業	100	873.00	87,300
ダイキン工業	1,500	11,340.00	17,010,000
トーヨーカネツ	1,000	339.00	339,000
栗田工業	700	2,687.00	1,880,900
椿本チエイン	1,000	911.00	911,000
大同工業	1,000	272.00	272,000
木村化工機	100	345.00	34,500
アネスト岩田	200	1,108.00	221,600
ダイフク	600	2,523.00	1,513,800
加藤製作所	100	3,100.00	310,000
タダノ	600	1,444.00	866,400
フジテック	300	1,335.00	400,500
C K D	300	1,540.00	462,000
キトー	100	1,252.00	125,200
平和	300	2,734.00	820,200
理想科学工業	100	2,039.00	203,900
SANKYO	300	3,800.00	1,140,000
日本金銭機械	100	1,499.00	149,900
マースエンジニアリング	100	2,255.00	225,500
福島工業	100	3,590.00	359,000
オーイズミ	100	685.00	68,500
竹内製作所	200	2,450.00	490,000
アマノ	300	2,192.00	657,600
JUKI	200	1,209.00	241,800



サンデンホールディングス	1,000	354.00	354,000
蛇の目ミシン工業	100	834.00	83,400
グローリー	400	3,510.00	1,404,000
新晃工業	100	1,420.00	142,000
大和冷機工業	200	977.00	195,400
セガサミーホールディングス	1,100	1,788.00	1,966,800
リケン	100	4,330.00	433,000
T P R	100	3,245.00	324,500
ツバキ・ナカシマ	100	1,870.00	187,000
ホンザキ	200	9,240.00	1,848,000
大豊工業	100	1,565.00	156,500
日本精工	2,300	1,429.00	3,286,700
N T N	3,000	516.00	1,548,000
ジェイテクト	1,200	1,904.00	2,284,800
不二越	1,000	570.00	570,000
日本トムソン	400	532.00	212,800
T H K	800	2,814.00	2,251,200
ユーシン精機	100	3,070.00	307,000
前澤給装工業	100	1,525.00	152,500
イーグル工業	100	1,515.00	151,500
前澤工業	100	369.00	36,900
日本ピラー工業	100	1,377.00	137,700
キッツ	500	690.00	345,000
日立工機	300	868.00	260,400
マキタ	700	7,530.00	5,271,000
日立造船	900	597.00	537,300
三菱重工業	19,000	509.00	9,671,000
I H I	8,000	305.00	2,440,000
スター精密	200	1,730.00	346,000
日清紡ホールディングス	600	1,074.00	644,400
イビデン	800	1,556.00	1,244,800
コニカミノルタ	2,700	1,074.00	2,899,800
ブラザー工業	1,400	2,121.00	2,969,400
ミネベアミツミ	2,136	1,143.00	2,441,448
日立製作所	27,000	648.20	17,501,400
東芝	25,000	244.30	6,107,500

三菱電機	12,100	1,742.50	21,084,250
富士電機	3,000	674.00	2,022,000
安川電機	1,300	2,063.00	2,681,900
シンフォニアテクノロジー	1,000	295.00	295,000
明電舎	1,000	356.00	356,000
デンヨー	200	1,645.00	329,000
東芝テック	1,000	611.00	611,000
マブチモーター	300	5,870.00	1,761,000
日本電産	1,500	10,770.00	16,155,000
東光高岳	100	2,339.00	233,900
ダブル・スコープ	100	1,928.00	192,800
ダイヘン	1,000	727.00	727,000
田淵電機	200	402.00	80,400
ヤーマン	100	6,490.00	649,000
JVCケンウッド	800	301.00	240,800
ミマキエンジニアリング	100	688.00	68,800
第一精工	100	1,357.00	135,700
日新電機	200	1,375.00	275,000
オムロン	1,200	4,935.00	5,922,000
日東工業	200	1,548.00	309,600
I D E C	100	1,140.00	114,000
不二電機工業	100	1,419.00	141,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	2,000	466.00	932,000
サクサホールディングス	1,000	253.00	253,000
メルコホールディングス	100	3,210.00	321,000
テクノメディカ	100	2,086.00	208,600
日本電気	16,000	267.00	4,272,000
富士通	11,000	686.80	7,554,800
沖電気工業	500	1,653.00	826,500
岩崎通信機	1,000	88.00	88,000
アイホン	100	1,911.00	191,100
ルネサスエレクトロニクス	600	1,024.00	614,400
セイコーエプソン	1,700	2,409.00	4,095,300
ワコム	900	340.00	306,000
アルバック	200	4,005.00	801,000

アクセル	100	837.00	83,700
E I Z O	100	3,195.00	319,500
ジャパンディスプレイ	2,100	312.00	655,200
日本信号	300	1,080.00	324,000
能美防災	100	1,755.00	175,500
ホーチキ	100	1,406.00	140,600
エレコム	100	1,918.00	191,800
日本無線	100	1,322.00	132,200
パナソニック	12,900	1,185.00	15,286,500
アンリツ	800	811.00	648,800
日立国際電気	300	2,541.00	762,300
ソニー	8,000	3,410.00	27,280,000
T D K	600	8,190.00	4,914,000
アルプス電気	1,000	3,135.00	3,135,000
池上通信機	1,000	161.00	161,000
パイオニア	1,700	250.00	425,000
日本電波工業	100	883.00	88,300
鈴木	100	517.00	51,700
ローランド ディー . ジー .	100	3,490.00	349,000
フォスター電機	100	1,755.00	175,500
クラリオン	1,000	421.00	421,000
ヨコオ	100	1,105.00	110,500
ティアック	1,000	45.00	45,000
ホシデン	300	872.00	261,600
ヒロセ電機	200	14,820.00	2,964,000
T O A	100	1,018.00	101,800
日立マクセル	200	2,320.00	464,000
古野電気	100	744.00	74,400
ユニデンホールディングス	1,000	165.00	165,000
アルパイン	300	1,737.00	521,100
スミダコーポレーション	100	1,121.00	112,100
アイコム	100	2,334.00	233,400
船井電機	100	908.00	90,800
横河電機	1,200	1,805.00	2,166,000
アズビル	300	3,405.00	1,021,500
東亜ディーケーケー	100	545.00	54,500

日本光電工業	500	2,568.00	1,284,000
チノー	100	1,205.00	120,500
共和電業	200	406.00	81,200
日本電子材料	100	625.00	62,500
堀場製作所	200	5,930.00	1,186,000
アドバンテスト	800	2,126.00	1,700,800
小野測器	100	870.00	87,000
エスペック	100	1,287.00	128,700
パナソニック デバイスSUNX	100	804.00	80,400
キーエンス	600	43,860.00	26,316,000
日置電機	100	2,184.00	218,400
シスメックス	900	6,840.00	6,156,000
日本マイクロニクス	200	1,106.00	221,200
メガチップス	100	2,769.00	276,900
コーセル	200	1,315.00	263,000
新日本無線	100	381.00	38,100
オプテックスグループ	100	2,655.00	265,500
千代田インテグレ	100	2,414.00	241,400
レーザーテック	100	2,553.00	255,300
スタンレー電気	800	3,185.00	2,548,000
ウシオ電機	700	1,448.00	1,013,600
岡谷電機産業	100	413.00	41,300
ヘリオス テクノ ホールディング	100	578.00	57,800
日本セラミック	100	2,144.00	214,400
遠藤照明	100	918.00	91,800
双信電機	100	297.00	29,700
山一電機	100	1,295.00	129,500
図研	100	1,287.00	128,700
カシオ計算機	900	1,563.00	1,406,700
ファナック	1,100	22,155.00	24,370,500
日本シイエムケイ	200	667.00	133,400
エンプラス	100	3,465.00	346,500
ローム	500	7,280.00	3,640,000
浜松ホトニクス	900	3,295.00	2,965,500
三井ハイテック	100	867.00	86,700
新光電気工業	400	710.00	284,000

京セラ	1,800	6,095.00	10,971,000
太陽誘電	500	1,351.00	675,500
村田製作所	1,200	14,640.00	17,568,000
ユーシン	200	857.00	171,400
双葉電子工業	200	1,978.00	395,600
北陸電気工業	1,000	138.00	138,000
ニチコン	400	1,069.00	427,600
日本ケミコン	1,000	263.00	263,000
K O A	200	1,302.00	260,400
小糸製作所	700	5,960.00	4,172,000
ミツバ	200	1,970.00	394,000
S C R E E Nホールディングス	200	7,150.00	1,430,000
キャノン電子	100	1,761.00	176,100
キャノン	6,100	3,292.00	20,081,200
リコー	3,500	932.00	3,262,000
東京エレクトロン	800	11,550.00	9,240,000
トヨタ紡織	400	2,547.00	1,018,800
ユニプレス	200	2,412.00	482,400
豊田自動織機	1,000	5,470.00	5,470,000
モリタホールディングス	200	1,626.00	325,200
三櫻工業	100	837.00	83,700
デンソー	2,700	4,959.00	13,389,300
東海理化電機製作所	300	2,276.00	682,800
三井造船	4,000	182.00	728,000
川崎重工業	9,000	351.00	3,159,000
名村造船所	300	757.00	227,100
サノヤスホールディングス	200	286.00	57,200
ニチュ三菱フォークリフト	100	812.00	81,200
日産自動車	13,600	1,112.00	15,123,200
いすゞ自動車	3,300	1,541.00	5,085,300
トヨタ自動車	13,800	6,546.00	90,334,800
日野自動車	1,600	1,285.00	2,056,000
三菱自動車工業	4,200	689.00	2,893,800
エフテック	100	1,284.00	128,400
レシップホールディングス	100	898.00	89,800
G M B	100	1,211.00	121,100

武蔵精密工業	200	3,140.00	628,000
日産車体	500	1,086.00	543,000
極東開発工業	200	1,707.00	341,400
日信工業	300	1,990.00	597,000
トピー工業	100	3,195.00	319,500
曙ブレーキ工業	500	312.00	156,000
タチエス	200	1,862.00	372,400
N O K	500	2,333.00	1,166,500
フタバ産業	300	693.00	207,900
K Y B	1,000	557.00	557,000
大同メタル工業	100	1,084.00	108,400
プレス工業	600	519.00	311,400
ミクニ	200	395.00	79,000
カルソニックカンセイ	1,000	1,803.00	1,803,000
太平洋工業	200	1,413.00	282,600
ケーヒン	300	2,041.00	612,300
河西工業	200	1,301.00	260,200
アイシン精機	1,000	5,180.00	5,180,000
富士機工	200	466.00	93,200
マツダ	3,600	1,639.00	5,900,400
今仙電機製作所	100	1,007.00	100,700
本田技研工業	10,200	3,415.00	34,833,000
スズキ	2,200	4,456.00	9,803,200
富士重工業	3,500	4,470.00	15,645,000
ヤマハ発動機	1,600	2,366.00	3,785,600
ショーワ	300	791.00	237,300
T B K	200	493.00	98,600
エクセディ	200	3,045.00	609,000
豊田合成	400	2,750.00	1,100,000
愛三工業	200	943.00	188,600
ヨロズ	100	1,565.00	156,500
エフ・シー・シー	200	2,191.00	438,200
シマノ	500	17,780.00	8,890,000
タカタ	200	554.00	110,800
テイ・エス テック	300	2,751.00	825,300
ジャムコ	100	2,566.00	256,600

テルモ	1,700	4,130.00	7,021,000
日機装	400	1,056.00	422,400
島津製作所	1,500	1,945.00	2,917,500
JMS	1,000	325.00	325,000
長野計器	100	699.00	69,900
オーバル	100	292.00	29,200
東京精密	200	3,700.00	740,000
マニー	200	2,730.00	546,000
ニコン	2,000	1,826.00	3,652,000
トプコン	600	1,839.00	1,103,400
オリンパス	1,800	3,905.00	7,029,000
理研計器	100	1,700.00	170,000
タムロン	100	2,049.00	204,900
HOYA	2,300	4,881.00	11,226,300
ノーリツ鋼機	200	915.00	183,000
エー・アンド・デイ	100	490.00	49,000
シチズン時計	1,200	708.00	849,600
リズム時計工業	1,000	182.00	182,000
大研医器	100	804.00	80,400
メニコン	100	3,380.00	338,000
松風	100	1,353.00	135,300
セイコーホールディングス	1,000	416.00	416,000
ニプロ	800	1,272.00	1,017,600
スノーピーク	100	2,999.00	299,900
パラマウントベッドホールディングス	100	4,675.00	467,500
トランザクション	100	2,063.00	206,300
SHO-BI	100	424.00	42,400
ニホンフラッシュ	100	1,231.00	123,100
前田工織	100	1,321.00	132,100
アートネイチャー	100	744.00	74,400
ダンロップスポーツ	100	1,040.00	104,000
バンダイナムコホールディングス	1,300	3,175.00	4,127,500
アイフィスジャパン	100	416.00	41,600
共立印刷	200	328.00	65,600
SHOEI	100	2,557.00	255,700

フランスベッドホールディングス	100	932.00	93,200
パイロットコーポレーション	200	4,575.00	915,000
トッパン・フォームズ	200	1,099.00	219,800
フジシールインターナショナル	200	2,394.00	478,800
タカラトミー	400	1,227.00	490,800
廣済堂	200	412.00	82,400
A s - m e エステール	100	697.00	69,700
アーク	500	121.00	60,500
タカノ	100	894.00	89,400
プロネクサス	100	1,234.00	123,400
ホクシン	100	232.00	23,200
ウッドワン	1,000	274.00	274,000
大建工業	100	2,153.00	215,300
凸版印刷	3,000	1,104.00	3,312,000
大日本印刷	3,000	1,154.00	3,462,000
日本写真印刷	200	3,125.00	625,000
宝印刷	100	1,500.00	150,000
アシックス	1,100	2,150.00	2,365,000
ヤマハ	800	3,450.00	2,760,000
クリナップ	100	913.00	91,300
ビジョン	700	3,140.00	2,198,000
キングジム	100	850.00	85,000
リンテック	200	2,535.00	507,000
イトーキ	200	724.00	144,800
任天堂	700	22,625.00	15,837,500
三菱鉛筆	100	6,080.00	608,000
タカラスタンダード	200	1,933.00	386,600
コクヨ	600	1,387.00	832,200
グローブライド	100	1,833.00	183,300
岡村製作所	400	1,144.00	457,600
美津濃	1,000	589.00	589,000
東京電力ホールディングス	9,600	439.00	4,214,400
中部電力	3,700	1,514.00	5,601,800
関西電力	4,600	1,228.00	5,648,800
中国電力	1,600	1,256.00	2,009,600
北陸電力	1,100	1,144.00	1,258,400



東北電力	2,800	1,414.00	3,959,200
四国電力	1,000	1,105.00	1,105,000
九州電力	2,500	1,249.00	3,122,500
北海道電力	1,100	810.00	891,000
沖縄電力	200	2,526.00	505,200
電源開発	900	2,773.00	2,495,700
イーレックス	100	3,305.00	330,500
東京瓦斯	12,000	501.30	6,015,600
大阪瓦斯	11,000	434.30	4,777,300
東邦瓦斯	3,000	841.00	2,523,000
広島ガス	200	366.00	73,200
西部瓦斯	1,000	254.00	254,000
静岡ガス	300	742.00	222,600
メタウォーター	100	2,866.00	286,600
SBSホールディングス	200	805.00	161,000
東武鉄道	6,000	575.00	3,450,000
相鉄ホールディングス	2,000	571.00	1,142,000
東京急行電鉄	6,000	830.00	4,980,000
京浜急行電鉄	3,000	1,322.00	3,966,000
小田急電鉄	1,900	2,240.00	4,256,000
京王電鉄	3,000	929.00	2,787,000
京成電鉄	900	2,666.00	2,399,400
東日本旅客鉄道	2,200	10,320.00	22,704,000
西日本旅客鉄道	1,100	7,374.00	8,111,400
東海旅客鉄道	900	18,505.00	16,654,500
西武ホールディングス	1,600	1,884.00	3,014,400
鴻池運輸	200	1,491.00	298,200
西日本鉄道	1,000	498.00	498,000
ハマキョウレックス	100	2,186.00	218,600
近鉄グループホールディングス	12,000	435.00	5,220,000
阪急阪神ホールディングス	1,500	3,840.00	5,760,000
南海電気鉄道	2,000	559.00	1,118,000
京阪ホールディングス	3,000	755.00	2,265,000
名古屋鉄道	4,000	558.00	2,232,000
日本通運	5,000	584.00	2,920,000
ヤマトホールディングス	2,100	2,310.00	4,851,000

山九	2,000	726.00	1,452,000
丸運	100	252.00	25,200
センコー	500	739.00	369,500
ニッコンホールディングス	400	2,332.00	932,800
福山通運	1,000	616.00	616,000
セイノーホールディングス	900	1,279.00	1,151,100
日立物流	200	2,262.00	452,400
C & F ロジホールディングス	200	1,300.00	260,000
九州旅客鉄道	900	3,065.00	2,758,500
日本郵船	10,000	245.00	2,450,000
商船三井	6,000	352.00	2,112,000
川崎汽船	4,000	276.00	1,104,000
N S ユナイテッド海運	1,000	220.00	220,000
明治海運	100	429.00	42,900
飯野海運	600	464.00	278,400
日本航空	2,000	3,638.00	7,276,000
A N A ホールディングス	22,000	340.00	7,480,000
三菱倉庫	1,000	1,627.00	1,627,000
三井倉庫ホールディングス	1,000	339.00	339,000
住友倉庫	1,000	610.00	610,000
東陽倉庫	200	292.00	58,400
ケイヒン	1,000	153.00	153,000
中央倉庫	100	1,081.00	108,100
安田倉庫	100	750.00	75,000
宇徳	100	402.00	40,200
上組	1,000	1,100.00	1,100,000
キムラユニティー	100	1,199.00	119,900
郵船ロジスティクス	100	1,175.00	117,500
近鉄エクスプレス	300	1,567.00	470,100
東海運	100	456.00	45,600
エーアイティー	100	1,094.00	109,400
内外トランスライン	100	1,096.00	109,600
N E C ネットズエスアイ	100	2,081.00	208,100
システナ	100	1,810.00	181,000
新日鉄住金ソリューションズ	200	2,274.00	454,800
キューブシステム	100	686.00	68,600

コア	100	1,383.00	138,300
ソフトクリエイトホールディングス	100	1,384.00	138,400
T I S	400	2,547.00	1,018,800
ネオス	100	438.00	43,800
グリー	700	612.00	428,400
コーエーテックモホールディングス	300	1,981.00	594,300
ファインデックス	100	925.00	92,500
K L a b	200	622.00	124,400
ポールトゥウィン・ピットクルー ホールディ	100	1,084.00	108,400
ネクソン	1,200	1,750.00	2,100,000
アイスタイル	200	764.00	152,800
エムアップ	100	651.00	65,100
エイチーム	100	2,091.00	209,100
テクノスジャパン	100	1,214.00	121,400
e n i s h	100	542.00	54,200
コロブラ	300	984.00	295,200
モバイルクリエイト	100	421.00	42,100
オルトプラス	100	582.00	58,200
ブロードリーフ	300	693.00	207,900
ハーツユナイテッドグループ	100	1,720.00	172,000
ブイキューブ	100	669.00	66,900
ディー・エル・イー	100	702.00	70,200
VOYAGE GROUP	100	1,633.00	163,300
ティーガイア	100	1,850.00	185,000
日本アジアグループ	200	434.00	86,800
豆蔵ホールディングス	100	1,012.00	101,200
ガンホー・オンライン・エンターテ イメント	2,300	244.00	561,200
GMOペイメントゲートウェイ	100	5,930.00	593,000
ザッパラス	100	441.00	44,100
インターネットイニシアティブ	200	1,819.00	363,800
さくらインターネット	100	1,228.00	122,800
システムインテグレータ	100	660.00	66,000
朝日ネット	200	512.00	102,400
フリービット	100	922.00	92,200
g u m i	100	1,281.00	128,100

LINE	200	3,615.00	723,000
AOI TYO Holdings	100	843.00	84,300
ソルクシーズ	100	545.00	54,500
野村総合研究所	800	3,860.00	3,088,000
サイバネットシステム	100	669.00	66,900
インテージホールディングス	100	2,121.00	212,100
東邦システムサイエンス	100	645.00	64,500
ソースネクスト	100	678.00	67,800
フォーカスシステムズ	100	591.00	59,100
フジ・メディア・ホールディングス	1,100	1,641.00	1,805,100
オービック	400	5,340.00	2,136,000
ジャストシステム	200	1,253.00	250,600
TDCソフトウェアエンジニアリング	100	1,260.00	126,000
ヤフー	8,000	472.00	3,776,000
トレンドマイクロ	600	4,410.00	2,646,000
日本オラクル	200	6,380.00	1,276,000
フューチャー	200	799.00	159,800
CAC Holdings	100	945.00	94,500
トーセ	100	824.00	82,400
オービックビジネスコンサルタント	100	5,470.00	547,000
伊藤忠テクノソリューションズ	300	3,110.00	933,000
アイティフォー	100	627.00	62,700
大塚商会	300	5,810.00	1,743,000
サイボウズ	200	459.00	91,800
ソフトブレーン	200	468.00	93,600
電通国際情報サービス	100	2,072.00	207,200
デジタルガレージ	200	2,073.00	414,600
C I J	200	523.00	104,600
日本エンタープライズ	200	279.00	55,800
WOWOW	100	3,625.00	362,500
スカラ	100	806.00	80,600
日本コロムビア	100	678.00	67,800
イマジカ・ロボットホールディングス	100	727.00	72,700
ネットワンシステムズ	500	778.00	389,000
システムソフト	200	152.00	30,400

アルゴグラフィックス	100	2,444.00	244,400
マーベラス	200	892.00	178,400
エイベックス・グループ・ホールディングス	200	1,704.00	340,800
日本ユニシス	300	1,453.00	435,900
兼松エレクトロニクス	100	2,584.00	258,400
東京放送ホールディングス	700	1,983.00	1,388,100
日本テレビホールディングス	1,000	2,075.00	2,075,000
朝日放送	100	744.00	74,400
テレビ朝日ホールディングス	300	2,239.00	671,700
スカパーJ S A Tホールディングス	700	505.00	353,500
テレビ東京ホールディングス	100	2,356.00	235,600
U - N E X T	100	679.00	67,900
コネクシオ	100	1,485.00	148,500
日本通信	900	174.00	156,600
クロップス	100	586.00	58,600
日本電信電話	9,000	4,958.00	44,622,000
K D D I	11,100	3,036.00	33,699,600
光通信	100	10,350.00	1,035,000
N T T ドコモ	8,400	2,717.00	22,822,800
エムティーアイ	200	722.00	144,400
G M O インターネット	400	1,640.00	656,000
カドカワ	300	1,744.00	523,200
ゼンリン	100	2,190.00	219,000
昭文社	100	699.00	69,900
インプレスホールディングス	100	152.00	15,200
アイネット	100	1,200.00	120,000
松竹	1,000	1,344.00	1,344,000
東宝	700	3,250.00	2,275,000
エヌ・ティ・ティ・データ	700	5,620.00	3,934,000
D T S	100	2,569.00	256,900
スクウェア・エニックス・ホールディングス	400	3,225.00	1,290,000
シーイーシー	100	1,865.00	186,500
カプコン	300	2,411.00	723,300
ジャステック	100	1,060.00	106,000
S C S K	300	4,210.00	1,263,000

日本システムウエア	100	1,709.00	170,900
アイネス	100	1,145.00	114,500
T K C	100	3,490.00	349,000
富士ソフト	200	2,780.00	556,000
N S D	200	1,785.00	357,000
コナミホールディングス	500	4,640.00	2,320,000
J B C Cホールディングス	100	814.00	81,400
ミロク情報サービス	100	1,674.00	167,400
ソフトバンクグループ	5,000	8,805.00	44,025,000
高千穂交易	100	1,024.00	102,400
あらた	100	2,739.00	273,900
フィールズ	100	1,243.00	124,300
双日	6,600	291.00	1,920,600
アルフレッサ ホールディングス	1,300	1,855.00	2,411,500
横浜冷凍	300	1,036.00	310,800
ラサ商事	100	696.00	69,600
ラクーン	100	497.00	49,700
アルコニックス	100	1,790.00	179,000
神戸物産	100	3,670.00	367,000
あい ホールディングス	200	2,133.00	426,600
ダイワボウホールディングス	1,000	286.00	286,000
マクニカ・富士エレホールディングス	200	1,615.00	323,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	200	1,024.00	204,800
八洲電機	100	632.00	63,200
U K Cホールディングス	100	2,190.00	219,000
T O K A Iホールディングス	500	850.00	425,000
三洋貿易	100	1,669.00	166,900
ウイン・パートナーズ	100	971.00	97,100
シップヘルスケアホールディングス	200	2,995.00	599,000
コメダホールディングス	200	1,877.00	375,400
富士興産	100	455.00	45,500
小野建	100	1,384.00	138,400
佐島電機	100	740.00	74,000
エコトレーディング	100	702.00	70,200
伯東	100	1,033.00	103,300

コンドーテック	100	859.00	85,900
中山福	100	820.00	82,000
ナガイレーベン	200	2,578.00	515,600
三菱食品	100	3,395.00	339,500
松田産業	100	1,539.00	153,900
第一興商	200	4,460.00	892,000
メディバルホールディングス	1,200	1,813.00	2,175,600
アズワン	100	5,220.00	522,000
スズデン	100	1,046.00	104,600
尾家産業	100	1,130.00	113,000
シモジマ	100	1,166.00	116,600
ドウシシャ	100	2,068.00	206,800
高速	100	1,088.00	108,800
黒田電気	200	2,265.00	453,000
丸文	100	689.00	68,900
ハピネット	100	1,280.00	128,000
日本ライフライン	100	2,201.00	220,100
エクセル	100	1,491.00	149,100
I D O M	300	732.00	219,600
日本エム・ディ・エム	100	845.00	84,500
進和	100	1,810.00	181,000
エスケイジャパン	100	304.00	30,400
ダイトロン	100	975.00	97,500
シークス	100	4,110.00	411,000
田中商事	100	710.00	71,000
オーハシテクニカ	100	1,438.00	143,800
白銅	100	1,552.00	155,200
伊藤忠商事	8,100	1,552.50	12,575,250
丸紅	11,000	684.90	7,533,900
長瀬産業	700	1,558.00	1,090,600
蝶理	100	1,966.00	196,600
豊田通商	1,200	3,100.00	3,720,000
三共生興	200	418.00	83,600
兼松	2,000	197.00	394,000
三井物産	10,200	1,659.00	16,921,800
日本紙パルプ商事	1,000	369.00	369,000

日立ハイテクノロジーズ	400	4,915.00	1,966,000
カメイ	100	1,284.00	128,400
山善	400	976.00	390,400
住友商事	7,000	1,422.50	9,957,500
三菱商事	8,400	2,573.00	21,613,200
キャノンマーケティングジャパン	300	2,224.00	667,200
西華産業	1,000	350.00	350,000
佐藤商事	100	857.00	85,700
菱洋エレクトロ	100	1,520.00	152,000
東京産業	200	464.00	92,800
ユアサ商事	100	3,105.00	310,500
小林産業	100	274.00	27,400
阪和興業	1,000	769.00	769,000
カナデン	100	1,023.00	102,300
フルサト工業	100	1,691.00	169,100
岩谷産業	1,000	633.00	633,000
三愛石油	300	873.00	261,900
稲畑産業	300	1,326.00	397,800
明和産業	100	388.00	38,800
ワキタ	200	1,047.00	209,400
東邦ホールディングス	400	2,424.00	969,600
サンゲツ	400	1,993.00	797,200
ミツウロコグループホールディングス	200	710.00	142,000
伊藤忠エネクス	200	952.00	190,400
サンリオ	300	2,272.00	681,600
サンワテクノス	100	994.00	99,400
リョーサン	200	3,535.00	707,000
新光商事	100	1,216.00	121,600
トーヨー	100	2,502.00	250,200
三信電気	100	1,250.00	125,000
東陽テクニカ	100	982.00	98,200
モスフードサービス	100	3,350.00	335,000
加賀電子	100	2,002.00	200,200
ソーダニッカ	100	509.00	50,900
立花エレテック	100	1,366.00	136,600



フォーバル	100	718.00	71,800
PALTAC	200	3,000.00	600,000
三谷産業	100	383.00	38,300
太平洋興発	1,000	104.00	104,000
ヤマタネ	100	1,635.00	163,500
日鉄住金物産	100	4,680.00	468,000
トラスコ中山	300	2,560.00	768,000
オートバックスセブン	400	1,808.00	723,200
加藤産業	200	2,784.00	556,800
イノテック	100	622.00	62,200
イエローハット	100	2,767.00	276,700
JKホールディングス	100	594.00	59,400
北沢産業	100	211.00	21,100
杉本商事	100	1,555.00	155,500
因幡電機産業	200	4,055.00	811,000
バイテックホールディングス	100	1,264.00	126,400
ミスミグループ本社	1,300	2,069.00	2,689,700
アルテック	100	212.00	21,200
スズケン	500	3,755.00	1,877,500
ジェコス	100	1,166.00	116,600
ルネサスイーストン	100	570.00	57,000
ローソン	400	8,250.00	3,300,000
サンエー	100	5,270.00	527,000
カワチ薬品	100	2,962.00	296,200
エービーシー・マート	200	6,570.00	1,314,000
ハードオフコーポレーション	100	1,157.00	115,700
アスクル	100	3,680.00	368,000
ゲオホールディングス	200	1,308.00	261,600
アダストリア	200	3,060.00	612,000
ジーフット	100	817.00	81,700
くらコーポレーション	100	4,680.00	468,000
キャンドウ	100	1,840.00	184,000
パルグループホールディングス	100	2,851.00	285,100
エディオン	400	1,090.00	436,000
サーラコーポレーション	100	615.00	61,500
ひらまつ	200	658.00	131,600

ハニーズ	100	1,094.00	109,400
ファーマライズホールディングス	100	507.00	50,700
アルベン	100	2,023.00	202,300
クオール	100	1,492.00	149,200
ジェイアイエヌ	100	5,900.00	590,000
ビックカメラ	600	1,054.00	632,400
D C Mホールディングス	700	1,013.00	709,100
M o n o t a R O	400	3,075.00	1,230,000
東京一番フーズ	100	563.00	56,300
きちり	100	654.00	65,400
J . フロント リテイリング	1,400	1,654.00	2,315,600
ドトール・日レスホールディングス	200	2,179.00	435,800
マツモトキヨシホールディングス	200	5,570.00	1,114,000
ブロンコビリー	100	2,781.00	278,100
スタートトゥデイ	1,000	2,500.00	2,500,000
ココカラファイン	100	4,870.00	487,000
三越伊勢丹ホールディングス	2,200	1,343.00	2,954,600
ウエルシアホールディングス	100	6,340.00	634,000
クリエイト S Dホールディングス	200	2,516.00	503,200
丸善 C H Iホールディングス	200	361.00	72,200
ネクステージ	100	2,406.00	240,600
ジョイフル本田	200	3,095.00	619,000
麒麟堂ホールディングス	100	855.00	85,500
ホットランド	100	1,076.00	107,600
すかいらーく	500	1,537.00	768,500
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	400	994.00	397,600
ブックオフコーポレーション	100	820.00	82,000
あさひ	100	1,315.00	131,500
コスモス薬品	100	21,080.00	2,108,000
トーエル	100	940.00	94,000
一六堂	100	392.00	39,200
セブン&アイ・ホールディングス	4,700	4,558.00	21,422,600
薬王堂	100	2,060.00	206,000
クリエイト・レストランツ・ホールディング	300	997.00	299,100
ツルハホールディングス	300	10,640.00	3,192,000

サンマルクホールディングス	100	3,425.00	342,500
フェリシモ	100	1,016.00	101,600
トリドールホールディングス	200	2,466.00	493,200
パロックジャパンリミテッド	100	1,627.00	162,700
クスリのアオキホールディングス	100	4,735.00	473,500
メディカルシステムネットワーク	100	419.00	41,900
総合メディカル	100	4,090.00	409,000
はるやまホールディングス	100	894.00	89,400
ノジマ	100	1,356.00	135,600
カップ・クリエイト	200	1,326.00	265,200
ライトオン	100	979.00	97,900
ジーンズメイト	100	262.00	26,200
良品計画	100	21,300.00	2,130,000
三城ホールディングス	100	459.00	45,900
アドヴァン	100	1,112.00	111,200
コナカ	100	580.00	58,000
G - 7ホールディングス	100	2,108.00	210,800
イオン北海道	100	610.00	61,000
コジマ	200	276.00	55,200
ヒマラヤ	100	857.00	85,700
コーナン商事	200	2,109.00	421,800
エコス	100	1,237.00	123,700
ワタミ	100	1,097.00	109,700
マルシェ	100	826.00	82,600
ドンキホーテホールディングス	700	4,150.00	2,905,000
西松屋チェーン	200	1,426.00	285,200
ゼンショーホールディングス	600	1,950.00	1,170,000
幸楽苑ホールディングス	100	1,619.00	161,900
ハークスレイ	100	1,092.00	109,200
サイゼリヤ	200	2,638.00	527,600
V Tホールディングス	400	559.00	223,600
ポプラ	100	517.00	51,700
ユナイテッドアローズ	100	3,180.00	318,000
ハイデイ日高	100	2,705.00	270,500
京都きもの友禅	100	984.00	98,400
コロワイド	400	1,904.00	761,600

ピーシーデボコーポレーション	100	627.00	62,700
壱番屋	100	3,760.00	376,000
トップカルチャー	100	480.00	48,000
P L A N T	100	1,200.00	120,000
スギホールディングス	200	5,270.00	1,054,000
スクロール	200	349.00	69,800
ヨンドシーホールディングス	100	2,520.00	252,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	500	7,250.00	3,625,000
木曽路	100	2,374.00	237,400
サトレストランシステムズ	100	836.00	83,600
千趣会	200	740.00	148,000
タカキュー	100	214.00	21,400
ケーヨー	200	575.00	115,000
日本瓦斯	200	3,285.00	657,000
ベスト電器	400	141.00	56,400
ロイヤルホールディングス	200	1,926.00	385,200
いなげや	100	1,545.00	154,500
島忠	300	2,757.00	827,100
チヨダ	100	2,701.00	270,100
ライフコーポレーション	100	3,315.00	331,500
リンガーハット	100	2,354.00	235,400
さが美	1,000	121.00	121,000
M r M a x	100	404.00	40,400
テナアライド	200	389.00	77,800
A O K Iホールディングス	200	1,421.00	284,200
コメリ	200	2,561.00	512,200
青山商事	200	3,975.00	795,000
しまむら	100	14,710.00	1,471,000
はせがわ	100	448.00	44,800
高島屋	2,000	974.00	1,948,000
松屋	200	990.00	198,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	600	1,883.00	1,129,800
パルコ	100	1,104.00	110,400
丸井グループ	1,200	1,645.00	1,974,000
アクシアル リテイリング	100	4,380.00	438,000

井筒屋	100	394.00	39,400
イオン	4,600	1,643.00	7,557,800
イズミ	200	4,855.00	971,000
平和堂	200	2,672.00	534,400
フジ	100	2,382.00	238,200
ヤオコー	100	4,605.00	460,500
ゼビオホールディングス	200	1,701.00	340,200
ケーズホールディングス	500	2,040.00	1,020,000
Olympicグループ	100	621.00	62,100
日産東京販売ホールディングス	200	341.00	68,200
アインホールディングス	100	8,230.00	823,000
ヤマダ電機	3,800	624.00	2,371,200
アークランドサカモト	200	1,373.00	274,600
ニトリホールディングス	500	12,800.00	6,400,000
愛眼	100	196.00	19,600
ケーユーホールディングス	100	860.00	86,000
吉野家ホールディングス	400	1,643.00	657,200
松屋フーズ	100	4,100.00	410,000
サガミチェーン	100	1,308.00	130,800
関西スーパーマーケット	100	1,504.00	150,400
王将フードサービス	100	4,385.00	438,500
プレナス	100	2,457.00	245,700
ミニストップ	100	2,074.00	207,400
アークス	200	2,569.00	513,800
バローホールディングス	200	2,985.00	597,000
大庄	100	1,572.00	157,200
ファーストリテイリング	200	35,920.00	7,184,000
サンドラッグ	200	7,810.00	1,562,000
サックスパー ホールディングス	100	1,196.00	119,600
やまや	100	1,705.00	170,500
ペルーナ	300	831.00	249,300
じもとホールディングス	800	192.00	153,600
めぶきフィナンシャルグループ	5,400	440.00	2,376,000
東京ＴＹフィナンシャルグループ	200	4,005.00	801,000
九州フィナンシャルグループ	1,900	786.00	1,493,400
ゆうちょ銀行	3,200	1,373.00	4,393,600

富山第一銀行	300	527.00	158,100
コンコルディア・フィナンシャルグループ	7,300	598.90	4,371,970
西日本フィナンシャルホールディングス	800	1,191.00	952,800
新生銀行	11,000	199.00	2,189,000
あおぞら銀行	7,000	410.00	2,870,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	84,800	727.40	61,683,520
りそなホールディングス	13,100	588.40	7,708,040
三井住友トラスト・ホールディングス	2,300	4,167.00	9,584,100
三井住友フィナンシャルグループ	9,000	4,413.00	39,717,000
第四銀行	1,000	506.00	506,000
北越銀行	100	2,704.00	270,400
千葉銀行	4,000	744.00	2,976,000
群馬銀行	2,500	626.00	1,565,000
武蔵野銀行	200	3,375.00	675,000
千葉興業銀行	300	593.00	177,900
筑波銀行	500	353.00	176,500
七十七銀行	2,000	532.00	1,064,000
青森銀行	1,000	376.00	376,000
秋田銀行	1,000	359.00	359,000
山形銀行	1,000	494.00	494,000
岩手銀行	100	4,590.00	459,000
東邦銀行	1,000	428.00	428,000
東北銀行	1,000	156.00	156,000
みちのく銀行	1,000	190.00	190,000
ふくおかフィナンシャルグループ	5,000	505.00	2,525,000
静岡銀行	3,000	994.00	2,982,000
十六銀行	2,000	393.00	786,000
スルガ銀行	1,100	2,631.00	2,894,100
八十二銀行	2,200	678.00	1,491,600
山梨中央銀行	1,000	539.00	539,000
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

滋賀銀行	1,000	644.00	644,000
南都銀行	100	4,565.00	456,500
百五銀行	1,000	469.00	469,000
京都銀行	2,000	906.00	1,812,000
紀陽銀行	400	1,827.00	730,800
ほくほくフィナンシャルグループ	800	1,958.00	1,566,400
広島銀行	3,000	537.00	1,611,000
山陰合同銀行	700	961.00	672,700
中国銀行	800	1,687.00	1,349,600
伊予銀行	1,200	766.00	919,200
百十四銀行	1,000	386.00	386,000
四国銀行	1,000	288.00	288,000
阿波銀行	1,000	726.00	726,000
大分銀行	1,000	427.00	427,000
宮崎銀行	1,000	379.00	379,000
佐賀銀行	1,000	291.00	291,000
十八銀行	1,000	350.00	350,000
沖縄銀行	100	4,090.00	409,000
琉球銀行	200	1,559.00	311,800
セブン銀行	4,200	326.00	1,369,200
みずほフィナンシャルグループ	152,000	208.70	31,722,400
山口フィナンシャルグループ	1,000	1,253.00	1,253,000
名古屋銀行	100	4,150.00	415,000
北洋銀行	1,800	460.00	828,000
第三銀行	100	1,748.00	174,800
愛媛銀行	100	1,379.00	137,900
みなと銀行	100	2,105.00	210,500
京葉銀行	1,000	522.00	522,000
関西アーバン銀行	200	1,528.00	305,600
栃木銀行	600	585.00	351,000
東和銀行	2,000	117.00	234,000
福島銀行	1,000	97.00	97,000
大東銀行	1,000	167.00	167,000
トモニホールディングス	900	609.00	548,100
フィデアホールディングス	1,100	206.00	226,600
池田泉州ホールディングス	1,200	508.00	609,600

F P G	400	1,005.00	402,000
S B I ホールディングス	1,300	1,574.00	2,046,200
日本アジア投資	100	469.00	46,900
ジャフコ	200	3,845.00	769,000
大和証券グループ本社	10,000	719.70	7,197,000
野村ホールディングス	22,900	721.20	16,515,480
岡三証券グループ	1,000	740.00	740,000
丸三証券	400	956.00	382,400
東洋証券	1,000	268.00	268,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	1,300	632.00	821,600
水戸証券	300	308.00	92,400
いちよし証券	300	883.00	264,900
松井証券	600	967.00	580,200
だいこう証券ビジネス	100	624.00	62,400
マネックスグループ	1,200	304.00	364,800
カブドットコム証券	800	386.00	308,800
極東証券	200	1,633.00	326,600
岩井コスモホールディングス	100	1,073.00	107,300
藍澤證券	200	650.00	130,000
マネーパートナーズグループ	100	531.00	53,100
かんぽ生命保険	500	2,597.00	1,298,500
S O M P O ホールディングス	2,300	4,101.00	9,432,300
アニコム ホールディングス	100	2,306.00	230,600
M S & A D インシュアランスグループホール	3,300	3,811.00	12,576,300
ソニーフィナンシャルホールディングス	1,100	1,865.00	2,051,500
第一生命ホールディングス	6,700	2,066.50	13,845,550
東京海上ホールディングス	4,500	4,730.00	21,285,000
T & D ホールディングス	4,100	1,697.50	6,959,750
アドバンスクリエイト	100	2,007.00	200,700
全国保証	300	3,895.00	1,168,500
クレディセゾン	800	2,067.00	1,653,600
アクリーティブ	100	429.00	42,900
芙蓉総合リース	100	5,580.00	558,000
興銀リース	200	2,503.00	500,600



東京センチュリー	200	3,840.00	768,000
日本証券金融	500	619.00	309,500
アイフル	1,900	335.00	636,500
ポケットカード	100	603.00	60,300
リコーリース	100	3,460.00	346,000
イオンフィナンシャルサービス	700	2,016.00	1,411,200
アコム	2,300	476.00	1,094,800
ジャックス	1,000	518.00	518,000
オリエントコーポレーション	2,500	221.00	552,500
日立キャピタル	300	2,914.00	874,200
アプラスフィナンシャル	600	120.00	72,000
オリックス	7,900	1,722.00	13,603,800
三菱UFJリース	2,900	601.00	1,742,900
日本取引所グループ	3,500	1,667.00	5,834,500
アサックス	100	1,626.00	162,600
いちご	1,100	360.00	396,000
日本駐車場開発	1,300	154.00	200,200
ヒューリック	2,300	1,109.00	2,550,700
野村不動産ホールディングス	700	1,953.00	1,367,100
三重交通グループホールディングス	200	392.00	78,400
サムティ	100	1,154.00	115,400
ディア・ライフ	100	386.00	38,600
エー・ディー・ワークス	1,100	43.00	47,300
日本商業開発	100	1,963.00	196,300
プレサンスコーポレーション	200	1,378.00	275,600
THEグローバル社	100	454.00	45,400
日本管理センター	100	1,279.00	127,900
フージャースホールディングス	100	608.00	60,800
オープンハウス	200	2,661.00	532,200
東急不動産ホールディングス	2,700	660.00	1,782,000
飯田グループホールディングス	900	2,119.00	1,907,100
パーク24	500	3,100.00	1,550,000
三井不動産	6,000	2,612.50	15,675,000
三菱地所	8,000	2,159.50	17,276,000
平和不動産	200	1,534.00	306,800
東京建物	1,300	1,488.00	1,934,400

ダイビル	300	1,063.00	318,900
京阪神ビルディング	200	602.00	120,400
住友不動産	3,000	3,050.00	9,150,000
大京	2,000	230.00	460,000
テーオーシー	400	916.00	366,400
レオパレス21	1,400	649.00	908,600
スターツコーポレーション	100	1,967.00	196,700
フジ住宅	100	757.00	75,700
空港施設	100	595.00	59,500
明和地所	100	733.00	73,300
住友不動産販売	100	2,579.00	257,900
ゴールドクレスト	100	2,046.00	204,600
日本エスリード	100	1,397.00	139,700
日神不動産	200	529.00	105,800
日本エスコン	200	383.00	76,600
タカラレーベン	500	618.00	309,000
サンヨーハウジング名古屋	100	1,012.00	101,200
イオンモール	700	1,647.00	1,152,900
ファースト住建	100	1,423.00	142,300
トーセイ	200	758.00	151,600
エヌ・ティ・ティ都市開発	700	989.00	692,300
サンフロンティア不動産	100	1,019.00	101,900
エフ・ジェー・ネクスト	100	758.00	75,800
ランドビジネス	100	282.00	28,200
グランディハウス	100	419.00	41,900
日本空港ビルデング	400	4,050.00	1,620,000
日本工営	100	2,609.00	260,900
ネクスト	300	774.00	232,200
ジェイエイシーリクルートメント	100	1,410.00	141,000
日本M&Aセンター	300	3,325.00	997,500
アコーディア・ゴルフ	400	1,203.00	481,200
タケエイ	100	1,055.00	105,500
パソナグループ	100	775.00	77,500
CDS	100	1,027.00	102,700
リンクアンドモチベーション	300	454.00	136,200
GCA	100	814.00	81,400

エス・エム・エス	200	2,684.00	536,800
テンプホールディングス	1,000	2,022.00	2,022,000
リニカル	100	1,284.00	128,400
クックパッド	300	1,013.00	303,900
エスクリ	100	615.00	61,500
アイ・ケイ・ケイ	100	705.00	70,500
学情	100	1,188.00	118,800
シミックホールディングス	100	1,496.00	149,600
総合警備保障	400	4,110.00	1,644,000
カカクコム	800	1,993.00	1,594,400
ルネサンス	100	1,540.00	154,000
ディップ	200	2,302.00	460,400
オプトホールディング	100	719.00	71,900
新日本科学	100	565.00	56,500
ツクイ	300	770.00	231,000
キャリアデザインセンター	100	1,197.00	119,700
エムスリー	1,100	3,035.00	3,338,500
ツカダ・グローバルホールディング	100	650.00	65,000
アウトソーシング	100	3,705.00	370,500
ウェルネット	100	1,350.00	135,000
ディー・エヌ・エー	500	2,364.00	1,182,000
博報堂D Yホールディングス	1,700	1,397.00	2,374,900
ぐるなび	200	2,516.00	503,200
エスアールジータカミヤ	100	597.00	59,700
ジャパンベストレスキューシステム	200	244.00	48,800
ファンコミュニケーションズ	300	728.00	218,400
WDBホールディングス	100	1,311.00	131,100
ティア	100	639.00	63,900
バリューコマース	200	343.00	68,600
インフォマート	500	639.00	319,500
J Pホールディングス	300	261.00	78,300
E P Sホールディングス	100	1,443.00	144,300
レッグス	100	844.00	84,400
プレステージ・インターナショナル	200	824.00	164,800
アミューズ	100	1,791.00	179,100
クイック	100	1,130.00	113,000

T A C	100	235.00	23,500
ケネディクス	1,600	420.00	672,000
電通	1,300	5,210.00	6,773,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	100	776.00	77,600
シーティーエス	100	1,530.00	153,000
みらかホールディングス	300	5,250.00	1,575,000
アルプス技研	100	2,645.00	264,500
日本空調サービス	200	623.00	124,600
オリエンタルランド	1,300	6,208.00	8,070,400
ダスキン	300	2,521.00	756,300
明光ネットワークジャパン	100	1,253.00	125,300
ファルコホールディングス	100	1,481.00	148,100
秀英予備校	100	515.00	51,500
ラウンドワン	400	824.00	329,600
リゾートトラスト	500	2,081.00	1,040,500
ピー・エム・エル	200	2,748.00	549,600
ワタベウェディング	100	519.00	51,900
りらいあコミュニケーションズ	200	1,148.00	229,600
リソー教育	200	600.00	120,000
ユー・エス・エス	1,500	1,987.00	2,980,500
東京個別指導学院	100	938.00	93,800
サイバーエージェント	600	2,889.00	1,733,400
楽天	6,100	1,106.00	6,746,600
クリーク・アンド・リバー社	100	1,014.00	101,400
テー・オー・ダブリュー	100	647.00	64,700
フルキャストホールディングス	100	944.00	94,400
テクノプロ・ホールディングス	200	3,935.00	787,000
リブセンス	100	451.00	45,100
ジャパンマテリアル	100	1,683.00	168,300
ベクトル	100	1,207.00	120,700
ウチヤマホールディングス	100	439.00	43,900
I B J	100	596.00	59,600
N・フィールド	100	1,432.00	143,200
E R Iホールディングス	100	795.00	79,500
リクルートホールディングス	2,500	5,120.00	12,800,000
日本郵政	3,100	1,418.00	4,395,800

ベルシステム24ホールディングス	200	992.00	198,400	
ソラスト	100	1,343.00	134,300	
エイチ・アイ・エス	200	2,966.00	593,200	
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	100	1,128.00	112,800	
建設技術研究所	100	1,053.00	105,300	
スペース	100	1,232.00	123,200	
東京都競馬	1,000	267.00	267,000	
カナモト	200	2,965.00	593,000	
東京ドーム	500	1,067.00	533,500	
西尾レントオール	100	3,250.00	325,000	
トランス・コスモス	100	2,720.00	272,000	
乃村工藝社	300	1,951.00	585,300	
藤田観光	1,000	359.00	359,000	
日本管財	100	1,767.00	176,700	
トーカイ	100	3,950.00	395,000	
セコム	1,200	8,180.00	9,816,000	
セントラル警備保障	100	1,984.00	198,400	
丹青社	200	869.00	173,800	
メイテック	200	4,275.00	855,000	
アサツー ディ・ケイ	200	2,976.00	595,200	
応用地質	100	1,423.00	142,300	
船井総研ホールディングス	200	1,768.00	353,600	
進学会	100	563.00	56,300	
オオバ	100	466.00	46,600	
ベネッセホールディングス	400	3,275.00	1,310,000	
イオンディライト	100	3,295.00	329,500	
ナック	100	975.00	97,500	
ニチイ学館	200	819.00	163,800	
ダイセキ	200	2,270.00	454,000	
ステップ	100	1,400.00	140,000	
小計	銘柄数：1,549		2,526,502,298	
	組入時価比率：97.9%		100.0%	
合計			2,526,502,298	

(注1)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## (2) 株式以外の有価証券(平成29年 2月 1日現在)

該当事項はありません。

## 第2 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

種類	平成29年 2月 1日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	49,832,650	-	50,523,000	686,786
合計	49,832,650	-	50,523,000	686,786

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 財形公社債マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(平成29年 2月 1日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	92,740,434
国債証券	753,466,800
地方債証券	1,014,932,546
特殊債券	1,671,571,274
社債券	673,736,264
未収入金	315,375,800
未収利息	8,475,702
前払費用	534,980
流動資産合計	4,530,833,800
資産合計	4,530,833,800
負債の部	
流動負債	
未払金	317,410,000
未払解約金	13,000,000
未払利息	182
流動負債合計	330,410,182
負債合計	330,410,182
純資産の部	

(平成29年 2月 1日現在)

元本等	
元本	3,051,969,969
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,148,453,649
元本等合計	4,200,423,618
純資産合計	4,200,423,618
負債純資産合計	4,530,833,800

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補 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よった場合、当該価額が異なることもあります。

(貸借対照表に関する注記)

平成29年 2月 1日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3763円
(10,000口当たり純資産額)	(13,763円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

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、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。

#### 市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。

#### 信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。

#### 流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

平成29年 2月 1日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券	
（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。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

### （その他の注記）

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

平成29年 2月 1日現在	
期首	平成28年 2月 2日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	2,939,619,664円
同期中における追加設定元本額	643,091,697円
同期中における一部解約元本額	530,741,392円
期末元本額	3,051,969,969円
期末元本額の内訳*	
財形株投（一般財形30）	1,026,984,338円
財形株投（一般財形50）	945,275,876円
財形株投（年金・住宅財形30）	1,079,709,755円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(平成29年 2月 1日現在)

該当事項はありません。



## (2) 株式以外の有価証券(平成29年 2月 1日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付(2年)第370回	100,000,000	100,626,000	
		国庫債券 利付(5年)第119回	100,000,000	100,691,000	
		国庫債券 利付(10年)第334回	460,000,000	479,646,600	
		国庫債券 利付(10年)第335回	70,000,000	72,503,200	
	小計	銘柄数: 4 組入時価比率: 17.9%	730,000,000	753,466,800 18.3%	
	合計		753,466,800		
地方債証券	日本円	東京都 公募第658回	100,000,000	102,698,000	
		北海道 公募平成21年度第14回	100,000,000	104,654,000	
		神奈川県 公募第161回	100,000,000	103,350,000	
		大阪府 公募第303回	30,000,000	30,230,902	
		京都府 公募平成28年度第3回	100,000,000	100,000,000	
		愛知県 公募平成20年度第7回	10,000,000	10,278,100	
		埼玉県 公募平成19年度第4回	50,000,000	50,596,738	
		新潟県 公募平成20年度第2回	12,700,000	13,100,812	
		岐阜県 公募平成20年度第1回	13,000,000	13,352,950	
		共同発行市場地方債 公募第76回	117,800,000	121,924,178	
		島根県 公募平成24年度第1回	10,500,000	10,519,950	
		福島県 公募平成20年度第1回	100,000,000	103,160,000	
		熊本県 公募(5年)平成25年度第1回	100,000,000	100,530,000	
		川崎市 公募第39回	100,000,000	100,456,000	
		福岡市 公募平成24年度第5回	50,000,000	50,080,916	
	小計	銘柄数: 15 組入時価比率: 24.2%	994,000,000	1,014,932,546 24.7%	
	合計		1,014,932,546		
特殊債券	日本円	日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第130回	100,000,000	102,993,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第7回	100,000,000	114,282,000	

		地方公共団体金融機構債券 第21回	100,000,000	105,510,000	
		首都高速道路 第17回	100,000,000	99,978,000	
		阪神高速道路 第11回	100,000,000	100,600,000	
		関西国際空港社債 財投機関債第38回	100,000,000	105,197,000	
		住宅金融支援機構債券 財投機関債第21回	100,000,000	103,151,000	
		商工債券 利付第742回い号	100,000,000	100,055,510	
		農林債券 利付第762回い号	100,000,000	100,545,000	
		農林債券 利付第797回い号	100,000,000	99,884,000	
		しんきん中金債券 利付第268回	100,000,000	100,055,510	
		東日本高速道路 第28回	100,000,000	100,685,000	
		東日本高速道路 第36回	100,000,000	100,109,000	
		中日本高速道路債券 財投機関債第3回	30,000,000	30,364,254	
		中日本高速道路社債 第33回	100,000,000	104,799,000	
		中日本高速道路社債 第49回	100,000,000	100,576,000	
		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第19回	100,000,000	102,787,000	
	小計	銘柄数：17 組入時価比率：39.8%	1,630,000,000	1,671,571,274	40.6%
	合計			1,671,571,274	
社債券	日本円	三菱東京UFJ銀行 第9回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,216,000	
		三菱東京UFJ銀行 第119回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,696,000	
		三井住友信託銀行 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,517,000	
		みずほ銀行 第34回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,564,000	
		東日本旅客鉄道 第7回社債間限定同順位特約付	60,000,000	61,083,640	
		東北電力 第459回	100,000,000	100,053,624	
		九州電力 第447回	100,000,000	99,606,000	
	小計	銘柄数：7 組入時価比率：16.0%	660,000,000	673,736,264	16.4%
	合計			673,736,264	
	合計			4,113,706,884	

(注1)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## 第2 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。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## 財形株投（一般財形50）

平成29年 2月28日現在

資産総額	2,693,070,513円
負債総額	5,584,178円
純資産総額（ - ）	2,687,486,335円
発行済口数	2,525,567,084口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0641円

## 財形株投（一般財形30）

平成29年 2月28日現在

資産総額	2,072,113,866円
負債総額	4,154,800円
純資産総額（ - ）	2,067,959,066円
発行済口数	2,011,459,350口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0281円

## 財形株投（年金・住宅財形30）

平成29年 2月28日現在

資産総額	2,194,768,584円
負債総額	2,980,011円
純資産総額（ - ）	2,191,788,573円
発行済口数	2,106,736,869口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0404円

## （参考）財形株式マザーファンド

平成29年 2月28日現在

資産総額	2,613,659,216円
負債総額	35,266,549円
純資産総額（ - ）	2,578,392,667円
発行済口数	1,893,767,562口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3615円

## （参考）財形公社債マザーファンド

平成29年 2月28日現在

資産総額	4,529,944,885円
負債総額	324,854,492円
純資産総額（ - ）	4,205,090,393円
発行済口数	3,053,350,256口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3772円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## (1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託者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、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

## (2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

## (3) 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係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、当該譲渡に係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、委託者は、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係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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえ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。

## (4) 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、委託者および受託者に対抗することができません。

## (5) 受益権の再分割

委託者は、受益権の再分割を行いません。ただし、社債、株式等の振替に関する法律が施行された場合には、受託者と協議のうえ、同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。

## (6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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一部解約の実行の請求の受け、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り扱われます。

## 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】

##### (1)資本金の額

平成29年3月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### (2)会社の機構

###### (a)会社の意思決定機構

当社は指名委員会等設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表執行役ならびに執行役、指名委員会、監査委員会および報酬委員会をおきますが、代表取締役および監査役会は設けません。各機関の権限は以下のとおりであります。

###### 株主総会

株主により構成され、取締役・会計監査人の選任・解任、剰余金の配当の承認、定款変更・合併等の重要事項の承認等を行います。

###### 取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また執行役・代表執行役、各委員会の委員等を選任し、取締役および執行役の職務の執行を監督します。

###### 代表執行役・執行役

各執行役は、当社の業務の執行を行います。代表執行役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表執行役および執行役で構成される経営会議および執行役会が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役会で選定された執行役員が含まれます。

###### 委員会

取締役3名以上（但し、各委員につき過半数は社外取締役であって執行役でない者）で構成され、イ）指名委員会は、株主総会に提出する取締役の選任・解任・不再任に関する議案の内容を決定し、ロ）報酬委員会は取締役・執行役が受ける個人別の報酬の決定に関する方針を定め、かつそれに従って各報酬の内容を決定し、ハ）監査委員会は取締役・執行役の職務執行の適法性ならびに妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容を決定します。

## (b)投資信託の運用体制



## 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部及び投資助言業務を行っています。

委託者の運用する証券投資信託は平成29年2月28日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
----	----	------------



追加型株式投資信託	944	20,980,509
単位型株式投資信託	67	306,824
追加型公社債投資信託	15	5,940,030
単位型公社債投資信託	328	1,937,875
合計	1,354	29,165,239

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)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)、ならびに同規則第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)により作成しております。

委託会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)、ならびに同規則第38条及び第57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)により作成しております。

2. 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。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(平成27年4月1日から平成28年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(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、新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

区分	注記 番号	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)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		411	208
金銭の信託		56,824	55,341
有価証券		17,100	24,100
前払金		15	34
前払費用		29	2
未収入金		330	511
未収委託者報酬		12,679	14,131
未収運用受託報酬		7,436	7,309
繰延税金資産		2,594	2,028
その他		73	56
貸倒引当金		9	10
流動資産計		97,486	103,715
固定資産			

有形固定資産			1,322		1,176
建物	2	413		403	
器具備品	2	909		773	
無形固定資産			7,254		7,681
ソフトウェア		7,253		7,680	
その他		1		0	
投資その他の資産			24,840		23,225
投資有価証券		11,593		9,216	
関係会社株式		10,149		10,958	
従業員長期貸付金		30		-	
長期差入保証金		49		45	
長期前払費用		60		49	
前払年金費用		2,776		2,777	
その他		179		176	
貸倒引当金		0		-	
固定資産計			33,417		32,083
資産合計			130,903		135,799

区分	注記 番号	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)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			118		118
未払金	1		11,602		11,855
未払収益分配金		1		1	
未払償還金		32		31	
未払手数料		4,883		4,537	
その他未払金		6,684		7,284	
未払費用	1		10,221		8,872
未払法人税等			1,961		1,838
前受収益			-		45
賞与引当金			4,558		4,809
外国税支払損失引当金			1,721		-
流動負債計			30,182		27,538
固定負債					
退職給付引当金			2,467		2,708
時効後支払損引当金			521		526
繰延税金負債			747		68
固定負債計			3,735		3,303
負債合計			33,918		30,842
(純資産の部)					
株主資本					
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			11,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		-		2,000	
利益剰余金			61,182		68,696
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		60,497		68,011	

別途積立金		24,606		24,606
繰越利益剰余金		35,890		43,405
評価・換算差額等			6,893	5,349
その他有価証券評価差額金			6,893	5,349
純資産合計			96,985	104,956
負債・純資産合計			130,903	135,799

## (2)【損益計算書】

区分	注記 番号	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)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			96,159		104,445
運用受託報酬			31,466		31,351
その他営業収益			221		219
営業収益計			127,847		136,016
営業費用					
支払手数料			47,060		46,531
広告宣伝費			823		1,008
公告費			-		0
受益証券発行費			5		5
調査費			28,326		28,068
調査費		1,299		4,900	
委託調査費		27,027		23,167	
委託計算費			1,156		1,148
営業雑経費			3,275		3,899
通信費		193		185	
印刷費		951		969	
協会費		77		78	
諸経費		2,053		2,666	
営業費用計			80,648		80,662
一般管理費					
給料			11,660		11,835
役員報酬	2	289		367	
給料・手当		6,874		6,928	
賞与		4,496		4,539	
交際費			131		124
旅費交通費			472		488
租税公課			501		695
不動産賃借料			1,218		1,230
退職給付費用			723		1,063
固定資産減価償却費			3,120		2,589
諸経費			6,815		7,801
一般管理費計			24,643		25,827
営業利益			22,555		29,526

区分	注記 番号	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)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,038		7,323	
受取利息		5		4	
金銭の信託運用益		347		-	
為替差益		-		281	
その他		366		382	
営業外収益計			4,756		7,991
営業外費用					
金銭の信託運用損		-		1,196	
時効後支払損引当金繰入額		28		72	
その他		137		52	
営業外費用計			166		1,321
經常利益			27,146		36,196
特別利益					
投資有価証券等売却益		794		50	
株式報酬受入益		142		96	
特別利益計			936		146
特別損失					
投資有価証券売却損		-		95	
投資有価証券等評価損		91		-	
固定資産除却損	3	357		60	
外国税支払損失引当金繰入額		1,721		-	
特別損失計			2,169		156
税引前当期純利益			25,913		36,186
法人税、住民税及び事業税			8,433		9,806
法人税等調整額			2,488		744
当期純利益			19,967		25,635

## ( 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 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
					別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	26,048	51,339	80,249

会計方針の変更による累積的影響額						81	81	81
会計方針の変更を反映した当期首残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	25,966	51,258	80,168
当期変動額								
剰余金の配当						10,043	10,043	10,043
当期純利益						19,967	19,967	19,967
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)								
当期変動額合計	-	-	-	-	-	9,923	9,923	9,923
当期末残高	17,180	11,729	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092

(単位：百万円)

	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	6,679	6,679	86,929
会計方針の変更による累積的影響額			81
会計方針の変更を反映した当期首残高	6,679	6,679	86,847
当期変動額			
剰余金の配当			10,043
当期純利益			19,967
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	213	213	213
当期変動額合計	213	213	10,137
当期末残高	6,893	6,893	96,985

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本			
	資本剰余金		利益剰余金	
				その他利益剰余金

	資本金	資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	株主資本合計
当期首残高	17,180	11,729	-	11,729	685	24,606	35,890	61,182	90,092
当期変動額									
剰余金の配当							19,933	19,933	19,933
当期純利益							25,635	25,635	25,635
合併による増加			2,000	2,000			144	144	2,144
吸収分割による増加							1,668	1,668	1,668
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	-	-	2,000	2,000	-	-	7,514	7,514	9,514
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606

(単位：百万円)

	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	6,893	6,893	96,985
当期変動額			
剰余金の配当			19,933
当期純利益			25,635
合併による増加			2,144
吸収分割による増加			1,668
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	1,543	1,543	1,543
当期変動額合計	1,543	1,543	7,971
当期末残高	5,349	5,349	104,956

## [重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法  (2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末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しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法
--------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法								
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table data-bbox="691 353 986 479"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 外国税支払損失引当金 将来発生する可能性のある外国税額のうち、当社において見込まれる負担所要額を計上しております。</p>								
5. 消費税等の会計処理方法	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理しております。								
6. 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。								

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

前事業年度末 (平成27年3月31日)	当事業年度末 (平成28年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。
未払金 4,979百万円	未払金 5,894百万円
未払費用 1,411	未払費用 1,151
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額
建物 607百万円	建物 641百万円
器具備品 3,052	器具備品 3,132
合計 3,659	合計 3,774

## 損益計算書関係

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。
受取配当金 3,966百万円	受取配当金 7,081百万円
2. 役員報酬の範囲額 役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されております。	2. 役員報酬の範囲額 (同左)
3. 固定資産除却損	3. 固定資産除却損
建物 円 - 百万	建物 1百万円
器具備品 15	器具備品 4
ソフトウェア 342	ソフトウェア 54
ア	ア
合計 357	合計 60

## 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

株式の種類	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
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成26年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

## 普通株式の配当に関する事項



配当金の総額	10,043百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	1,950円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月2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5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	19,933百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,870円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27年6月26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

株式の種類	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
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

平成27年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	19,933百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,870円
基準日	平成27年3月31日
効力発生日	平成27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28年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	34,973百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	6,790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

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

## （２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物、スワップ取引などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。

## ２．金融商品の時価等に関する事項

平成27年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	411	411	-
(2)金銭の信託	56,824	56,824	-
(3)未収委託者報酬	12,679	12,679	-
(4)有価証券及び投資有価証券	27,398	27,398	-
その他有価証券	27,398	27,398	-
(5)関係会社株式	3,064	196,109	193,045
資産計	100,378	293,423	193,045
(6)未払金	11,602	11,602	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	32	32	-
未払手数料	4,883	4,883	-
その他未払金	6,684	6,684	-
(7)未払費用	10,221	10,221	-

(8)未払法人税等	1,961	1,961	-
負債計	23,784	23,784	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産(コールローン・委託証拠金等)で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産について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)未収委託者報酬

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。

(4) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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、譲渡性預金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。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(5) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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。

注2：非上場株式等(貸借対照表計上額：投資有価証券1,294百万円、関係会社株式7,085百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積も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ため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について90百万円減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(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
預金	411	-	-	-
金銭の信託	56,824	-	-	-

未収委託者報酬	12,679	-	-	-
有価証券	17,100	-	-	-
合計	87,015	-	-	-

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### （1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

### （2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物、スワップ取引などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成28年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	208	208	-
(2)金銭の信託	55,341	55,341	-
(3)未収委託者報酬	14,131	14,131	-
(4)未収運用受託報酬	7,309	7,309	-

(5)有価証券及び投資有価証券	32,071	32,071	-
その他有価証券	32,071	32,071	-
(6)関係会社株式	3,064	180,880	177,816
資産計	112,127	289,944	177,816
(7)未払金	11,855	11,855	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	4,537	4,537	-
その他未払金	7,284	7,284	-
(8)未払費用	8,872	8,872	-
(9)未払法人税等	1,838	1,838	-
負債計	22,566	22,566	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産について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)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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。

(5) 有価証券及び投資有価証券

    その他有価証券

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、譲渡性預金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。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

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。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,245百万円、関係会社株式7,894百万円）は、市場価

格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積も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ため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(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
預金	208	-	-	-
金銭の信託	55,341	-	-	-
未収委託者報酬	14,131	-	-	-
未収運用受託報酬	7,309	-	-	-
有価証券	24,100	-	-	-
合計	101,091	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

1．売買目的有価証券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(平成27年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(平成27年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	196,109	193,045
合計	3,064	196,109	193,045

4．その他有価証券(平成27年3月31日)

区分	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			
株式	10,298	282	10,015
小計	10,298	282	10,015
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	17,100	17,100	-

小計	17,100	17,100	-
合計	27,398	17,382	10,015

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

区分	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)
株式	800	790	-
合計	800	790	-

（注）投資信託の「売却額」及び「売却損の合計額」は償還によるものであります。

## 当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 2．満期保有目的の債券(平成28年3月31日)

該当事項はありません。

## 3．子会社株式及び関連会社株式(平成28年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	180,880	177,816
合計	3,064	180,880	177,816

## 4．その他有価証券(平成28年3月31日)

区分	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			
株式	7,971	282	7,688
小計	7,971	282	7,688
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	24,100	24,100	-
小計	24,100	24,100	-
合計	32,071	24,382	7,688

## 5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

区分	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)
株式	135	-	95
合計	135	-	95

## 退職給付関係

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
1. 採用している退職給付制度の概要	
当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2. 確定給付制度	
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	15,680 百万円
会計方針の変更による累積的影響額	127
会計方針の変更を反映した期首残高	15,808
勤務費用	746
利息費用	213
数理計算上の差異の発生額	1,128
退職給付の支払額	724
その他	46
退職給付債務の期末残高	17,218
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	14,786 百万円
期待運用収益	369
数理計算上の差異の発生額	975
事業主からの拠出額	558
退職給付の支払額	573
年金資産の期末残高	16,117
(3) 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及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	14,474 百万円
年金資産	16,117
	1,643
非積立型制度の退職給付債務	2,743
未積立退職給付債務	1,100
未認識数理計算上の差異	1,861
未認識過去勤務費用	451
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	309
退職給付引当金	2,467
前払年金費用	2,776
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	309
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	746 百万円
利息費用	213
期待運用収益	369
数理計算上の差異の費用処理額	24
過去勤務費用の費用処理額	40
その他	24
確定給付制度に係る退職給付費用	550



## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	31%
株式	13%
受益証券等	29%
生保一般勘定	21%
その他	6%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	1.1%
退職一時金制度の割引率	0.8%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、172百万円でした。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	17,218 百万円
勤務費用	811
利息費用	181
数理計算上の差異の発生額	1,150
退職給付の支払額	654
その他	13
退職給付債務の期末残高	18,692

## (2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	16,117 百万円
期待運用収益	402
数理計算上の差異の発生額	711
事業主からの拠出額	511
退職給付の支払額	555
年金資産の期末残高	15,764

## (3) 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

## 及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	15,775 百万円
年金資産	15,764
	11
非積立型制度の退職給付債務	2,917
未積立退職給付債務	2,928
未認識数理計算上の差異	3,409
未認識過去勤務費用	411
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69
退職給付引当金	2,708
前払年金費用	2,777
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	69

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	811 百万円
利息費用	181
期待運用収益	402
数理計算上の差異の費用処理額	314
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	863

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	43%
株式	43%
生保一般勘定	13%
その他	1%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、191百万円でした。

## 税効果会計関係

前事業年度末 (平成27年3月31日)	当事業年度末 (平成28年3月31日)
------------------------	------------------------

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
繰延税金資産	百万円	繰延税金資産	百万円
関係会社株式評価減	1,784	関係会社株式評価減	1,676
賞与引当金	1,504	賞与引当金	1,490
退職給付引当金	789	退職給付引当金	839
所有株式税務簿価通算差異	690	所有株式税務簿価通算差異	669
投資有価証券評価減	475	投資有価証券評価減	460
未払事業税	387	未払事業税	350
ゴルフ会員権評価減	296	ゴルフ会員権評価減	240
減価償却超過額	186	減価償却超過額	177
時効後支払損引当金	166	時効後支払損引当金	163
子会社株式売却損	153	子会社株式売却損	148
関連会社株式譲渡益	169	関連会社株式譲渡益	120
未払社会保険料	92	未払社会保険料	89
外国税支払損失引当金	567	外国税支払損失引当金	-
その他	214	その他	251
繰延税金資産小計	7,479	繰延税金資産小計	6,678
評価性引当額	1,500	評価性引当額	1,453
繰延税金資産合計	5,979	繰延税金資産合計	5,224
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	3,243	その他有価証券評価差額金	2,403
前払年金費用	888	前払年金費用	861
繰延税金負債合計	4,132	繰延税金負債合計	3,264
繰延税金負債の純額	1,847	繰延税金資産の純額	1,959
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差異の原因となった主な項目別の内訳		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差異の原因となった主な項目別の内訳	
法定実効税率	36.0%	法定実効税率	33.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.0%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.2%
住民税等均等割	0.0%	住民税等均等割	0.0%
タックスヘイブン税制	1.2%	タックスヘイブン税制	0.8%
外国税額控除	0.2%	外国税額控除	0.2%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	-%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.7%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	1.8%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.4%
評価性引当額	7.3%	評価性引当額	0.0%
その他	2.8%	その他	0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	22.9%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%
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		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27年法律第9号)が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以降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36%から、平成27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33%に、平成28年4月1日に開始する前事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、32%となります。		「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13号)が平成28年3月29日に成立し、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%から31%となります。	
この税率変更により、繰延税金資産の純額は73百万円減少し、法人税等調整額が479百万円、その他有価証券評価差額金が405百万円、それぞれ増加しております。		この税率変更による財務諸表に与える影響は軽微であります。	

## 企業結合等関係

### 1. 会社分割について

当社は、野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社(以下「NFR&T」)との、平成27年2月18日付吸収分割契約に基づき、NFR&Tの機関投資家顧問事業及びリテール運用関連事業を会社分割により承継いたしました。

## (1) 企業結合の概要

### 会社分割の目的

本件会社分割により、当社は、NFR&Tが行ってきた投資信託の運用・管理に係る事務および機関投資家向けの顧問関連事業をNFR&Tから承継し、野村グループのアセット・マネジメント部門内における営業、運用、管理業務を集約します。ファンドおよび運用会社の分析・評価業務は、NFR&Tが集約して行います。これらの再編により、運用オペレーションの効率化と堅牢性の向上を図り、顧客に対する質の高いサービスの提供が可能となります。また、再編後の当社及びNFR&T両社は、それぞれの専門性を発揮することにより、品質の高い運用商品の提供を行い、投資家の多様なニーズに応えられると判断いたしました。

### 会社分割日程

吸収分割契約締結日	平成27年 2月 18日
機関投資家顧問事業の吸収分割効力発生日	平成27年 7月 1日
リテール運用関連事業の吸収分割効力発生日	平成27年 10月 1日

### 会社分割の方法

当社を分割承継会社とし、NFR&Tを分割会社とする無対価による吸収分割方式であります。

## (2) 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

## 2. 吸収合併について

当社は、野村プライベート・エクイティ・キャピタル株式会社(以下「NPEC」)との、平成27年2月18日付吸収合併契約に基づき、NPECを吸収合併いたしました。

## (1) 企業結合の概要

### 吸収合併の目的

運用オペレーションの効率化と堅牢性の向上を図り、顧客に対する質の高いサービスの提供を可能とするためであります。

### 吸収合併日程

吸収合併契約締結日	平成27年 2月 18日
吸収合併効力発生日	平成27年 12月 1日

### 吸収合併の方法

当社を吸収合併存続会社とし、NPECを吸収合併消滅会社とする無対価による吸収合併方式であります。

## (2) 実施した会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日)に基づき、共通支配下の取引として処理しております。

### セグメント情報等

前事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用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。

## 2. 関連情報

### (1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製

品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## （２）地域ごとの情報

### 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

### 有形固定資産

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

## （３）主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. セグメント情報

当社は投資運用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。

## 2. 関連情報

### （１）製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

### （２）地域ごとの情報

#### 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

#### 有形固定資産

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

### （３）主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 関連当事者情報

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

### （ア）親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

### （イ）子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)

関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	(所有)直接 21.4%	サービス・製品の購入	自社利用のソフトウェア開発の委託等(*1)	3,990	未払費用	547
------	-------------	---------	-----------------	---------	-----------------	------------	-----------------------	-------	------	-----

## (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業		当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2)	39,273	未払手数料	4,182
親会社の子会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社	東京都中央区	400 (百万円)	投資顧問業		当社投資信託の運用委託	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*3)	1,976	未払費用	815

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。

(\*2) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

(\*3) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

野村ホールディングス(株)(東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は(株)野村総合研究所であり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

(百万円)

(株)野村総合研究所

流動資産合計 229,418

固定資産合計 273,220

流動負債合計 87,832

固定負債合計 65,965

純資産合計	348,841
売上高	358,952
税引前当期純利益	51,509
当期純利益	34,167

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

### (ア) 親会社及び法人主要株主等

該当はありません。

### (イ) 子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	(所有)直接20.8%	サービス・製品の購入	自社利用のソフトウェア開発の委託等(*1)	5,058	未払費用	279

### (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業		当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2)	39,084	未払手数料	3,865
親会社の子会社	野村ファンド・リサーチ・アンド・テクノロジー株式会社	東京都中央区	400 (百万円)	投資顧問業		当社投資信託の運用委託	投資信託の運用に係る投資顧問料の支払(*3)	2,412	未払費用	669

### (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(\*1) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。

(\*2) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

(\*3) 投資信託の運用に係る投資顧問料については、一般取引条件と同様に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

### (1) 親会社情報

野村ホールディングス(株)(東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、  
ニューヨーク証券取引所に上場)

### (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

当事業年度において、重要な関連会社は(株)野村総合研究所であり、その要約財務諸表は以下のとおりであります。

(百万円)	
(株)野村総合研究所	
流動資産合計	239,155
固定資産合計	324,634
流動負債合計	122,933
固定負債合計	55,456
純資産合計	385,400
売上高	352,003
税引前当期純利益	56,508
当期純利益	40,179

### 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	18,829円58銭	1株当たり純資産額	20,377円23銭
1株当たり当期純利益	3,876円72銭	1株当たり当期純利益	4,977円07銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	19,967百万円	損益計算書上の当期純利益	25,635百万円
普通株式に係る当期純利益	19,967百万円	普通株式に係る当期純利益	25,635百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

### 中間財務諸表

#### 中間貸借対照表

		平成28年9月30日現在
--	--	--------------



区分	注記 番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		231
金銭の信託		54,692
有価証券		4,400
未収委託者報酬		13,740
未収運用受託報酬		7,312
繰延税金資産		907
その他		612
貸倒引当金		10
流動資産計		81,887
固定資産		
有形固定資産	1	1,065
無形固定資産		7,506
ソフトウェア		7,505
その他		0
投資その他の資産		21,276
投資有価証券		7,976
関係会社株式		10,341
前払年金費用		2,689
その他		269
固定資産計		29,848
資産合計		111,736

		平成28年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
関係会社短期借入金		7,500
未払収益分配金		1
未払償還金		31
未払手数料		4,386
その他未払金	2	1,424
未払費用		7,900
未払法人税等		759
賞与引当金		2,268
その他		155
流動負債計		24,428
固定負債		
退職給付引当金		2,821
時効後支払損引当金		538
繰延税金負債		1,073
固定負債計		4,432
負債合計		28,860
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		78,415
資本剰余金		17,180
資本準備金		13,729
その他資本剰余金		11,729
利益剰余金		2,000
利益準備金		47,505
その他利益剰余金		685
別途積立金		46,820
繰越利益剰余金		24,606
繰越利益剰余金		22,213
評価・換算差額等		4,459
その他有価証券評価差額金		4,459
純資産合計		82,875

負債・純資産合計		111,736
----------	--	---------

## 中間損益計算書

区分	注記 番号	自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日
		金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		46,569
運用受託報酬		14,052
その他営業収益		112
営業収益計		60,735
営業費用		
支払手数料		19,457
調査費		13,191
その他営業費用		3,046
営業費用計		35,695
一般管理費	1	12,666
営業利益		12,373
営業外収益	2	6,027
営業外費用	3	26
経常利益		18,374
特別利益	4	76
税引前中間純利益		18,451
法人税、住民税及び事業税		2,145
法人税等調整額		2,524
中間純利益		13,781

## 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)

(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 準備金	利益剰余金			利益 剰余金 合計
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰越 利益 剰余金		

当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606
当中間期変動額									
剰余金の配当							34,973	34,973	34,973
中間純利益							13,781	13,781	13,781
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	-	-	-	-	-	-	21,191	21,191	21,191
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	22,213	47,505	78,415

(単位:百万円)

	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	5,349	5,349	104,956
当中間期変動額			
剰余金の配当			34,973
中間純利益			13,781
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	889	889	889
当中間期変動額合計	889	889	22,081
当中間期末残高	4,459	4,459	82,875

## [重要な会計方針]

1 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式...移動平均法による原価法 (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しております。) 時価のないもの...移動平均法による原価法
2 運用目的の金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
3 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法によっております。  (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
4 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率等により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。

	<p>(2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。</p> <p>退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
5 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、税抜き方式によっております。
6 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

## [会計方針の変更]

法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取扱い」（実務対応報告第32号平成28年6月17日）を当中間会計期間に適用し、平成28年4月1日以後に取得した建物附属設備及び構築物に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。

なお、当中間会計期間において、中間財務諸表に与える影響額は軽微であります。

## [注記事項]

## 中間貸借対照表関係

平成28年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	3,889百万円
2 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「その他未払金」に含めて表示しております。

## 中間損益計算書関係

自 平成28年4月1日	至 平成28年9月30日
-------------	--------------

1	減価償却実施額		
	有形固定資産	115百万円	
	無形固定資産	1,211百万円	
2	営業外収益のうち主要なもの		
	受取配当金	4,882百万円	
	金銭信託運用益	938百万円	
3	営業外費用のうち主要なもの		
	支払利息	11百万円	
	時効後支払損引当金繰入	14百万円	
4	特別利益の内訳		
	投資有価証券等売却益	5百万円	
	関係会社清算益	41百万円	
	株式報酬受入益	30百万円	

## 中間株主資本等変動計算書関係

自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日				
1	発行済株式に関する事項			
	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少
	普通株式	5,150,693株	-	-
				当中間会計期間末 5,150,693株
2	配当に関する事項			
	配当金支払額			
	平成28年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。			
	・普通株式の配当に関する事項			
	(1) 配当金の総額		34,973百万円	
	(2) 1株当たり配当額		6,790円	
	(3) 基準日		平成28年3月31日	
	(4) 効力発生日		平成28年6月24日	

## 金融商品関係

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）

## 金融商品の時価等に関する事項

平成28年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。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。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	231	231	-
(2)金銭の信託	54,692	54,692	-
(3)未収委託者報酬	13,740	13,740	-
(4)未収運用受託報酬	7,312	7,312	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	11,173	11,173	-
(6)関係会社株式	3,064	165,608	162,544

資産計	90,215	252,759	162,544
(7)未払金	5,844	5,844	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	4,386	4,386	-
その他未払金	1,424	1,424	-
(8)未払費用	7,900	7,900	-
(9)未払法人税等	759	759	-
負債計	22,004	22,044	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産について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) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬

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。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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、譲渡性預金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。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 関係会社株式

取引所の価格によっております。

(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払法人税等

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。

注2：非上場株式等（中間貸借対照表計上額：投資有価証券1,202百万円、関係会社株式7,277百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積も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ため、「(5) 有価証券及び投資有価証券」「(6) 関係会社株式」には含めておりません。

## 有価証券関係

当中間会計期間末（平成28年9月30日）

## 1．満期保有目的の債券(平成28年9月30日)

該当事項はありません。

## 2．子会社株式及び関連会社株式(平成28年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	時価 (百万円)	差額 (百万円)
関連会社株式	3,064	165,608	162,544
合計	3,064	165,608	162,544

## 3．その他有価証券(平成28年9月30日)

区分	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 株式	6,773	282	6,490
小計	6,773	282	6,490
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えない もの 譲渡性預金	4,400	4,400	-
小計	4,400	4,400	-
合計	11,173	4,682	6,490

## セグメント情報等

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．セグメント情報

当社は投資運用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。

## 2．関連情報

## (1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が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、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、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、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

## 1 株当たり情報

		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		16,090円12銭
1株当たり中間純利益		2,675円66銭
(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。		
2. 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。		
	中間純利益	13,781百万円
	普通株主に帰属しない金額	-
	普通株式に係る中間純利益	13,781百万円
	期中平均株式数	5,150千株

## [ 重要な後発事象 ]

平成28年10月27日開催の臨時株主総会において、親会社である野村ホールディングス株式会社に対して、保有する株式会社野村総合研究所、株式会社ジャフコ及び朝日火災海上保険株式会社の全株式を剰余金の配当として現物配当（適格現物分配）することを決議し、同日に配当を実施いたしました。

なお、平成28年9月30日現在における有価証券の保有目的は、株式会社野村総合研究所については関連会社株式、株式会社ジャフコ及び朝日火災海上保険株式会社についてはその他有価証券であります。

## 1. 配当財産の種類及び帳簿価額

株式会社野村総合研究所	普通株式	47,725,700株	3,064百万円
株式会社ジャフコ	普通株式	2,304,000株	282百万円
朝日火災海上保険株式会社	普通株式	124,300株	87百万円

## 2. 剰余金の配当効力発生日

平成28年10月27日（木）

## 3. 配当原資

利益剰余金

## 4 【利害関係人との取引制限】



委託者は、「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うことを内容とした運用を行うこと(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うことを内容とした運用を行うこと(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、委託者の親法人等(委託者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(委託者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うこと。

委託者の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行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うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託者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】

### (1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

委託者およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると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) 受託者

(a) 名称	(b) 資本金の額 <sup>*</sup>	(c) 事業の内容
三井住友信託銀行株式会社 (再信託受託者：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)	342,037百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

\* 平成29年2月末現在

#### (2) 販売会社

(a) 名称	(b) 資本金の額 <sup>*</sup>	(c) 事業の内容
--------	------------------------	-----------

野村證券株式会社	10,000百万円	「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。
----------	-----------	---------------------------------

\* 平成29年2月末現在

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託者

ファンドの受託会社（受託者）として、信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行いません。なお、信託業務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。

#### <再信託受託者の概要>

名称 : 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社  
 設立年月日 : 平成12年6月20日  
 業務の概要 : 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。

銀行免許取得日および  
 信託業務の認可取得日 : 平成12年7月13日

### (2) 販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いおよび販売を行ない、信託契約の一部解約に関する事務、受益権の買取りに関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、一部解約金・償還金の支払いに関する事務等を行いません。

## 3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

### (1) 受託者

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 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提出されております。

提出年月日	提出書類
平成28年 4月26日	有価証券届出書
平成28年 4月26日	有価証券報告書
平成28年10月25日	有価証券届出書の訂正届出書
平成28年10月25日	半期報告書

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月6日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 岩部俊夫指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 森重俊寛指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 櫻井雄一郎

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」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成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、野村アセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
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24日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 岩部 俊夫  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 森重 俊寛  
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50）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50）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

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 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24日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 岩部 俊夫  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 森重 俊寛  
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

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 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24日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 岩部 俊夫  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 森重 俊寛  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている財形株投（年金・住宅財形30）の平成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（年金・住宅財形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

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

2. 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21日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

### 新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 岩部俊夫指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 森重俊寛指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 櫻井雄一郎

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」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の平成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、分析的な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、野村アセットマネジメント株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成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。

#### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成28年10月27日付で、親会社である野村ホールディングス株式会社に対して、保有する株式を現物配当している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。