

「投資信託及び投資法人に係る運用報告書等に関する委員会決議」の一部改正

平成 21 年 1 月 16 日
(下線部分変更)

| 新 | 旧 | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|-----------|-----------|--|---|-----------|--|---------------------------------------|--|---|-----|-----------|--|---|-----------|--|---------------------------------------|--|
| <p>投資信託及び投資法人に係る運用報告書等に関する委員会決議</p> <p>この委員会決議は、投資信託及び投資法人に係る運用報告書等に関する規則に基づき自主規制委員会が委任された第 8 条、第 14 条に規定する運用報告書及び第 16 条第 3 項並びに第 16 条の 2 第 3 項に規定する月次開示に係る表示事項の様式及び表示要領を定める。</p> <p>1 規則第 8 条に規定する運用報告書に係る表示事項の様式及び表示要領は、別表 1 とする。</p> <p>別表 1 証券投資信託の運用報告書の様式及び表示例(規則第 2 条、第 3 条)</p> <p>1 .「ファンドの仕組み」(規則第 2 条第 1 項第 4 号)</p> <p>(略)</p> <p>2 .本文中の表示項目 (規則第 3 条)</p> <p>本文中に表示する項目の様式は、次のとおりとする。</p> <p>(1) ~ (2) (略)</p> <p>(4) 1 口<u>当たり</u>の費用明細</p> <p>イ . 様式例</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 10px auto;"> <p>計算期間が 6 ヶ月未満のファンド</p> </div> <p>1 口 (元本 X X 円) 当たりの費用明細</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項 目</th> <th style="text-align: center;">第 期 ~ 第 期</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行)</td> <td style="text-align: right;">円</td> </tr> <tr> <td>(b) 募集手数料</td> <td></td> </tr> <tr> <td>(c) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券)</td> <td></td> </tr> </tbody> </table> | 項 目 | 第 期 ~ 第 期 | (a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行) | 円 | (b) 募集手数料 | | (c) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券) | | <p>投資信託及び投資法人に係る運用報告書等に関する委員会決議</p> <p>(同 左)</p> <p>1 (同 左)</p> <p>別表 1 証券投資信託の運用報告書の様式及び表示例(規則第 2 条、第 3 条)</p> <p>1 .「ファンドの仕組み」(規則第 2 条第 1 項第 4 号)</p> <p>(同 左)</p> <p>2 .本文中の表示項目 (規則第 3 条)</p> <p>(同 左)</p> <p>(1) ~ (2) (同 左)</p> <p>(4) 1 口<u>当り</u>の費用明細</p> <p>イ . 様式例</p> <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; width: fit-content; margin: 10px auto;"> <p>計算期間が 6 ヶ月未満のファンド</p> </div> <p>1 口 (元本 X X 円) 当たりの費用明細</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">項 目</th> <th style="text-align: center;">第 期 ~ 第 期</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>(a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行)</td> <td style="text-align: right;">円</td> </tr> <tr> <td>(b) 募集手数料</td> <td></td> </tr> <tr> <td>(c) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券)</td> <td></td> </tr> </tbody> </table> | 項 目 | 第 期 ~ 第 期 | (a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行) | 円 | (b) 募集手数料 | | (c) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券) | |
| 項 目 | 第 期 ~ 第 期 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行) | 円 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (b) 募集手数料 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (c) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券) | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 項 目 | 第 期 ~ 第 期 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行) | 円 | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (b) 募集手数料 | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (c) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券) | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| 新 | | 旧 | |
|--|--|--|--|
| (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (商品) (先物・オプション) | | (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (新設) (先物・オプション) | |
| (d) 有価証券取引税 (株 式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) | | (d) 有価証券取引税 (株 式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) | |
| (e) 保管費用等 | | (e) 保管費用等 | |
| 合 計 | | 合 計 | |

計算期間が6ヶ月以上のファンド

1口(元本XX円)当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 |
|--|-----|
| (a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行) | 円 |
| (b) 募集手数料 | |
| (c) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (商品) (先物・オプション) | |
| (d) 有価証券取引税 (株 式) | |

計算期間が6ヶ月以上のファンド

1口(元本XX円)当たりの費用明細

| 項 目 | 当 期 |
|--|-----|
| (a) 信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行) | 円 |
| (b) 募集手数料 | |
| (c) 売買委託手数料 (株 式) (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (新設) (先物・オプション) | |
| (d) 有価証券取引税 (株 式) | |

| 新 | | | | 旧 | | | |
|--|----|---------|----|---|----|-------|--|
| (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) | | | | (新株予約権証券) (オプション証券等) (新株予約権付社債(転換社債)) (公社債) | | | |
| (e) 保管費用等 | | | | (e) 保管費用等 | | | |
| 合 計 | | | | 合 計 | | | |
| (注1) | | (略) | | (注1) | | (同 左) | |
| (注2) | | (略) | | (注2) | | (同 左) | |
| <p>ロ．1口<u>当たり</u>の費用明細の表示上の留意事項</p> <p>(注1)の計算方法及び実数を表示する場合の留意事項</p> <p>(イ)～(ヌ) (略)</p> <p>(ル)様式例における(c)株式(新株予約権証券及び株式の性質を有するオプション証券等を含む。) 及び商品の 売買委託手数料以外の項目については任意表示項目とし、表示しなくても差し支えないこととする。</p> <p>(ヲ) (略)</p> | | | | <p>ロ．1口<u>当り</u>の費用明細の表示上の留意事項</p> <p>(注1)の計算方法及び実数を表示する場合の留意事項</p> <p>(イ)～(ヌ) (同 左)</p> <p>(ル)様式例における(c)株式(新株予約権証券及び株式の性質を有するオプション証券等を含む) 売買委託手数料以外の項目については任意表示項目とし、表示しなくても差し支えないこととする。</p> <p>(ヲ) (同 左)</p> | | | |
| (5) 売買及び取引の状況 | | | | (5) 売買及び取引の状況 | | | |
| イ．様式例 | | | | イ．様式例 | | | |
| (イ) 直接投資ファンド | | | | (イ) 直接投資ファンド | | | |
| A～I | | (略) | | A～I | | (同 左) | |
| J 商品 | | | | (新 設) | | | |
| 計算期間が6ヶ月未満のファンド | | | | | | | |
| 過去6ヶ月間の売買状況(年 月 日から 年 月 日まで) | | | | | | | |
| 決算期 | | 第 期～第 期 | | | | | |
| 種類別 | | 買 付 | | 売 付 | | | |
| | | 数量 | 金額 | 数量 | 金額 | | |
| 邦 貨 建 | 金 | | 千円 | | 千円 | | |
| | 小豆 | | | | | | |
| | ⋮ | | | | | | |

| 新 | | | | | | | 旧 | | | | | | | | | |
|--|-------------|-----|----|------|-----|------|---|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| 外 貨 建 | 米 国 | 金 | | 千ドル | | 千ドル | | | | | | | | | | |
| | | 小豆 | | | | | | | | | | | | | | |
| | | ⋮ | | | | | | | | | | | | | | |
| | 英 国 | 金 | | 千ポンド | | 千ポンド | | | | | | | | | | |
| | | 小豆 | | | | | | | | | | | | | | |
| | | ⋮ | | | | | | | | | | | | | | |
| | ⋮ | ⋮ | | 千... | | 千... | | | | | | | | | | |
| | | ⋮ | | | | | | | | | | | | | | |
| | | ⋮ | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>(注1) 金額は受渡し代金。</p> <p>(注2) 数量については、任意表示項目とする。</p> | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; display: inline-block;">計算期間が6ヶ月以上のファンド</div> | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 期中の売買状況(年 月 日から 年 月 日まで) | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 種 類 別 | 買 付 | | | 売 付 | | | | | | | | | | | |
| | | 数量 | 金額 | | 数量 | 金額 | | | | | | | | | | |
| 邦 貨 建 | 金 | | 千円 | | 千円 | | | | | | | | | | | |
| | 小豆 | | | | | | | | | | | | | | | |
| | ⋮ | | | | | | | | | | | | | | | |
| 外 貨 建 | 米 国 | 金 | | 千ドル | | 千ドル | | | | | | | | | | |
| | | 小豆 | | | | | | | | | | | | | | |
| | | ⋮ | | | | | | | | | | | | | | |
| | 英 国 | 金 | | 千ポンド | | 千ポンド | | | | | | | | | | |
| | | 小豆 | | | | | | | | | | | | | | |
| | | ⋮ | | | | | | | | | | | | | | |
| | ⋮ | ⋮ | | 千... | | 千... | | | | | | | | | | |
| | | ⋮ | | | | | | | | | | | | | | |
| | | ⋮ | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>(注1) 金額は受渡し代金。</p> <p>(注2) 数量については、任意表示項目とする。</p> | | | | | | | | | | | | | | | | |

新

K 先物取引の種類別取引状況

計算期間が6ヶ月未満のファンド

| 決算期 | | 第 期 ~ 第 期 | | | |
|-----|---------------|-----------|-----|-------|-----|
| | | 買 建 | | 売 建 | |
| | | 新規買付額 | 決済額 | 新規売付額 | 決済額 |
| 国内 | 株式先物取引 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| | 債券先物取引 | | | | |
| | 商品先物取引 | | | | |
| | : | | | | |
| 外国 | 株式先物取引 | | | | |
| | 債券先物取引 | | | | |
| | 商品先物取引 | | | | |
| | : | | | | |

(注) 金額は受渡し代金。

計算期間が6ヶ月以上のファンド

| 種類別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-----|---------------|-------|-----|-------|-----|
| | | 新規買付額 | 決済額 | 新規売付額 | 決済額 |
| 国内 | 株式先物取引 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| | 債券先物取引 | | | | |
| | 商品先物取引 | | | | |
| | : | | | | |
| 外国 | 株式先物取引 | | | | |
| | 債券先物取引 | | | | |
| | 商品先物取引 | | | | |
| | : | | | | |

(注) 金額は受渡し代金。

旧

J 先物取引の種類別取引状況

計算期間が6ヶ月未満のファンド

| 決算期 | | 第 期 ~ 第 期 | | | |
|-----|--------------|-----------|-----|-------|-----|
| | | 買 建 | | 売 建 | |
| | | 新規買付額 | 決済額 | 新規売付額 | 決済額 |
| 国内 | 株式先物取引 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| | 債券先物取引 | | | | |
| | (新 設) | | | | |
| | : | | | | |
| 外国 | 株式先物取引 | | | | |
| | 債券先物取引 | | | | |
| | (新 設) | | | | |
| | : | | | | |

(注) 金額は受渡し代金。

計算期間が6ヶ月以上のファンド

| 種類別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-----|--------------|-------|-----|-------|-----|
| | | 新規買付額 | 決済額 | 新規売付額 | 決済額 |
| 国内 | 株式先物取引 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| | 債券先物取引 | | | | |
| | (新 設) | | | | |
| | : | | | | |
| 外国 | 株式先物取引 | | | | |
| | 債券先物取引 | | | | |
| | (新 設) | | | | |
| | : | | | | |

(注) 金額は受渡し代金。

| 新 | | | | | | | | | | 旧 | | | | | | | | | |
|-----------------|------------------|------------|----------|------------|------------|------------|----------|------------|------------|-----------------|-----------------|------------|----------|------------|------------|------------|----------|------------|------------|
| L オプションの種類別取引状況 | | | | | | | | | | K オプションの種類別取引状況 | | | | | | | | | |
| 計算期間が6ヶ月未満のファンド | | | | | | | | | | 計算期間が6ヶ月未満のファンド | | | | | | | | | |
| 決算期 | | 第 期～第 期 | | | | | | | | 決算期 | | 第 期～第 期 | | | | | | | |
| 種類別 | コール プット 別 | 買 建 | | | | 売 建 | | | | 種類別 | コール プット 別 | 買 建 | | | | 売 建 | | | |
| | | 新 規 買付額 | 決 済 額 | 権 利 行 使 | 権 利 放 棄 | 新 規 売付額 | 決 済 額 | 権 利 被行使 | 義 務 消 滅 | | | 新 規 買付額 | 決 済 額 | 権 利 行 使 | 権 利 放 棄 | 新 規 売付額 | 決 済 額 | 権 利 被行使 | 義 務 消 滅 |
| 国 内 | 株式指数オプション 取 引 | コール プット | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| | 個別株オプション 取 引 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 債券オプション 取 引 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 金 利 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 通 貨 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 商品指数オプション 取 引 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | : | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 外 国 | 株式指数オプション 取 引 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 個別株オプション 取 引 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 債券オプション 取 引 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 金 利 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 通 貨 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 国 内 | 株式指数オプション 取 引 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 個別株オプション 取 引 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 債券オプション 取 引 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 金 利 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 通 貨 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | (新 設) | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | : | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 外 国 | 株式指数オプション 取 引 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 個別株オプション 取 引 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 債券オプション 取 引 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 金 利 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 通 貨 | コール プット | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| 新 | | | | | | | | | |
|---|-----------------|------------|--|--|--|--|--|--|--|
| | 商品指数オプション 取引 | コール プット | | | | | | | |
| | : | コール プット | | | | | | | |

(注) 金額は受渡し代金。

計算期間が6ヶ月以上のファンド

| 旧 | | | | | | | | | |
|---|------|------------|--|--|--|--|--|--|--|
| | (新設) | コール プット | | | | | | | |
| | : | コール プット | | | | | | | |

(注) 金額は受渡し代金。

計算期間が6ヶ月以上のファンド

| 種類別 | コール プット 別 | 買 建 | | | | 売 建 | | | |
|--------|-----------------|------------|-------|------------|------------|------------|-------|------------|------------|
| | | 新 規 買付額 | 決 済 額 | 権 利 行 使 | 権 利 放 棄 | 新 規 売付額 | 決 済 額 | 権 利 被行使 | 義 務 消 滅 |
| 国 内 | 株式指数オプション 取引 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| | 個別株オプション 取引 | | | | | | | | |
| | 債券オプション 取引 | | | | | | | | |
| | 金 利 | | | | | | | | |
| | 通 貨 | | | | | | | | |
| | 商品指数オプション 取引 | | | | | | | | |
| | : | | | | | | | | |
| 外 国 | 株式指数オプション 取引 | | | | | | | | |
| | 個別株オプション 取引 | | | | | | | | |
| | 債券オプション 取引 | | | | | | | | |

| 種類別 | コール プット 別 | 買 建 | | | | 売 建 | | | |
|--------|-----------------|------------|-------|------------|------------|------------|-------|------------|------------|
| | | 新 規 買付額 | 決 済 額 | 権 利 行 使 | 権 利 放 棄 | 新 規 売付額 | 決 済 額 | 権 利 被行使 | 義 務 消 滅 |
| 国 内 | 株式指数オプション 取引 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| | 個別株オプション 取引 | | | | | | | | |
| | 債券オプション 取引 | | | | | | | | |
| | 金 利 | | | | | | | | |
| | 通 貨 | | | | | | | | |
| | (新設) | | | | | | | | |
| | : | | | | | | | | |
| 外 国 | 株式指数オプション 取引 | | | | | | | | |
| | 個別株オプション 取引 | | | | | | | | |
| | 債券オプション 取引 | | | | | | | | |

| 新 | | | | | | | | | |
|-----------------|------------|--|--|--|--|--|--|--|--|
| 金利 | コール プット | | | | | | | | |
| 通貨 | コール プット | | | | | | | | |
| 商品指数オプション 取引 | コール プット | | | | | | | | |
| : | コール プット | | | | | | | | |

(注) 金額は受渡し代金。

M スワップ及び先渡取引状況

計算期間が6ヶ月未満のファンド

スワップ及び先渡取引契約金額

| 種類 | 第 期 ~ 第 期 |
|------|-----------|
| | 取引契約金額 |
| 金利 | 百万円 |
| 通貨 | |
| 金利先渡 | |
| 為替先渡 | |
| 商品先渡 | |
| ... | |

(注) 金額は受渡し代金。

計算期間が6ヶ月以上のファンド

| 種類 | 当 期 |
|----|--------|
| | 取引契約金額 |
| 金利 | 百万円 |

| 旧 | | | | | | | | | |
|-------|------------|--|--|--|--|--|--|--|--|
| 金利 | コール プット | | | | | | | | |
| 通貨 | コール プット | | | | | | | | |
| (新 設) | コール プット | | | | | | | | |
| : | コール プット | | | | | | | | |

(注) 金額は受渡し代金。

L スワップ及び先渡取引状況

計算期間が6ヶ月未満のファンド

スワップ及び先渡取引契約金額

| 種類 | 第 期 ~ 第 期 |
|-------|-----------|
| | 取引契約金額 |
| 金利 | 百万円 |
| 通貨 | |
| 金利先渡 | |
| 為替先渡 | |
| (新 設) | |
| ... | |

(注) 金額は受渡し代金。

計算期間が6ヶ月以上のファンド

| 種類 | 当 期 |
|----|--------|
| | 取引契約金額 |
| 金利 | 百万円 |

| 新 | | 旧 | |
|--|--|--|--|
| 通貨 | | 通貨 | |
| 金利先渡 | | 金利先渡 | |
| 為替先渡 | | 為替先渡 | |
| 商品先渡 | | (新設) | |
| ... | | ... | |
| (注)金額は受渡し代金。 | | (注)金額は受渡し代金。 | |
| (口)間接投資ファンド (略) | | (口)間接投資ファンド (同左) | |
| <p>ロ.表示上の留意事項</p> <p>計算期間が6ヶ月未満のファンドは、当該運用報告書の作成期末から過去6ヶ月についての売買状況を合算して表示することとする。ただし、各決算期毎に表示しても差し支えない。</p> <p>(イ)直接投資ファンド</p> <p>表示する表を資産別に区別し、表示順序は、株式、新株予約権証券、オプション証券等、新株予約権付社債(転換社債)、公社債、投資信託受益証券及び投資証券、その他有価証券、金銭債権、約束手形、<u>商品</u>、先物、オプション、スワップ及び先渡取引の順とする。</p> <p>~ (略)</p> <p><u>J商品の数量については、任意表示事項とし、表示しなくても差し支えないこととする。</u></p> <p>— <u>K先物取引の種類別取引状況、Lオプションの種類別取引状況</u>について、派生商品を積極的に利用するファンドにおいては、(6)派生商品<u>Q</u>取引状況等で別途の区分で表示した場合は、省略できることとする。</p> <p>— (略)</p> <p>(口)間接投資ファンド (略)</p> <p>(6)派生商品<u>Q</u>取引状況等 (派生商品を積極的に利用するファンド) イ.様式例 A 先物取引の銘柄別取引・残高状況</p> | | <p>ロ.表示上の注意</p> <p>(同左)</p> <p>(イ)直接投資ファンド</p> <p>表示する表を資産別に区別し、表示順序は、株式、新株予約権証券、オプション証券等、新株予約権付社債(転換社債)、公社債、投資信託受益証券及び投資証券、その他有価証券、金銭債権、約束手形、先物、オプション、スワップ及び先渡取引の順とする。</p> <p>~ (同左)</p> <p>(新設)</p> <p>— <u>J先物取引の種類別取引状況、Kオプションの種類別取引状況</u>について、派生商品を積極的に利用するファンドにおいては、(6)派生商品取引状況等で別途の区分で表示した場合は、省略できることとする。</p> <p>— (同左)</p> <p>(口)間接投資ファンド (同左)</p> <p>(6)派生商品取引状況等 (派生商品を積極的に利用するファンド) イ.様式例 A 先物取引の銘柄別取引・残高状況</p> | |

| 新 | | | | | | | | | | 旧 | | | | | | | | | | |
|-----------------|--------|-----------|------------|-------|------------|-------|---------|-------|---------|-----------------|-----------|-------|------------|-------|------------|-------|---------|-------|---------|--|
| 計算期間が6ヶ月未満のファンド | | | | | | | | | | 計算期間が6ヶ月未満のファンド | | | | | | | | | | |
| 決算期 | | | 第 期～第 期 | | | | | | | 決算期 | | | 第 期～第 期 | | | | | | | |
| 銘柄別 | | | 買 建 | | 売 建 | | 作成期末評価額 | | | 銘柄別 | | | 買 建 | | 売 建 | | 作成期末評価額 | | | |
| | | | 新 規 買付額 | 決 済 額 | 新 規 売付額 | 決 済 額 | 買 建 額 | 売 建 額 | 評 価 損 益 | | | | 新 規 買付額 | 決 済 額 | 新 規 売付額 | 決 済 額 | 買 建 額 | 売 建 額 | 評 価 損 益 | |
| 国 内 | 株 式 | 日経225 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 国 内 | 株 式 | 日経225 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | |
| | | 日経300 | | | | | | | | | | | 日経300 | | | | | | | |
| | | : | | | | | | | | | | | : | | | | | | | |
| | 債 券 | : | | | | | | | | 国 内 | 債 券 | : | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 商 品 | : | | | | | | | | 国 内 | (新 設) | : | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| : | : | | | | | | | | : | : | | | | | | | | | | |
| 外 国 | 株 式 | S & P 500 | | | | | | | 外 国 | 株 式 | S & P 500 | | | | | | | | | |
| | | : | | | | | | | | | | : | | | | | | | | |
| | 債 券 | : | | | | | | | | 債 券 | : | | | | | | | | | |
| | 商 品 | : | | | | | | | | (新 設) | : | | | | | | | | | |
| | : | : | | | | | | | | : | : | | | | | | | | | |

| 新 | | | | | | | | | | 旧 | | | | | | | | | |
|-----------------|--------|------------|-------|------------|-------|--------|-------|---------|--------|-----------------|------------|-------|------------|-------|--------|-------|---------|-----|--|
| 計算期間が6ヶ月以上のファンド | | | | | | | | | | 計算期間が6ヶ月未満のファンド | | | | | | | | | |
| 銘柄別 | | 買 建 | | 売 建 | | 当期末評価額 | | | 銘柄別 | | 買 建 | | 売 建 | | 当期末評価額 | | | | |
| | | 新 規 買付額 | 決 済 額 | 新 規 売付額 | 決 済 額 | 買 建 額 | 売 建 額 | 評 価 損 益 | | | 新 規 買付額 | 決 済 額 | 新 規 売付額 | 決 済 額 | 買 建 額 | 売 建 額 | 評 価 損 益 | | |
| 国 内 | 株 式 | 日経225 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 株 式 | 日経225 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | |
| | | 日経300 | | | | | | | | | 日経300 | | | | | | | | |
| | | : | | | | | | | | | : | | | | | | | | |
| | 債 券 | : | | | | | | | | 債 券 | : | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 商 品 | : | | | | | | | | 商 品 | : | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| : | : | | | | | | | | : | : | | | | | | | | | |
| 外 国 | 株 式 | S & P 500 | | | | | | | 株 式 | S & P 500 | | | | | | | | | |
| | | : | | | | | | | | : | | | | | | | | | |
| | 債 券 | : | | | | | | | 債 券 | : | | | | | | | | | |
| | 商 品 | : | | | | | | | 商 品 | : | | | | | | | | | |
| | : | : | | | | | | | : | : | | | | | | | | | |

| 新 | | | | | | | | | | | | | 旧 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------|--------|--------|-----------------|-----------|-----|----------|----------|-----------|---------|------------|-----------|----------|--------------------|-----------|----------|--------------|-------|-----------------|-----------|-----|----------|----------|-----------|---------|------------|-----------|----------|----------|-----------|--|--|--|--|--|--|--|
| B オプションの銘柄別取引・残高状況 | | | | | | | | | | | | | B オプションの銘柄別取引・残高状況 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 計算期間が6ヶ月未満のファンド | | | | | | | | | | | | | 計算期間が6ヶ月未満のファンド | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 決算期 | | | 第 期～第 期 | | | | | | | | | | 決算期 | | | 第 期～第 期 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 銘柄別 | | | コール プット 別 | 買 建 | | | | 売 建 | | | | 作成期末評価額 | | | 種類別 | | | コール プット 別 | 買 建 | | | | 売 建 | | | | 作成期末評価額 | | | | | | | | | |
| | | | | 新規 買付額 | 決済額 | 権利 行使 | 権利 放棄 | 新規 売付額 | 決済 額 | 権 利 被行使 | 義 務 消滅 | 買 建 額 | 売 建 額 | 評 価 損益 | | | | | 新規 買付額 | 決済額 | 権利 行使 | 権利 放棄 | 新規 売付額 | 決済 額 | 権 利 被行使 | 義 務 消滅 | 買 建 額 | 売 建 額 | 評 価 損益 | | | | | | | |
| 国 内 | 株 式 | 日経225 | コール | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 株 式 | 日経225 | コール | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | | | | | | | | | |
| | | | プット | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | 日経300 | | | | | | | | | | | | | | | 日経300 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 債 券 | : | | | | | | | | | | | | | 債 券 | : | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 商 品 | : | | | | | | | | | | | | | (新 設) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 外 国 | 株 式 | S & P 500 | コール | | | | | | | | | | | 株 式 | S & P 500 | コール | | | | | | | | | | 株 式 | 個別株 | | | | | | | | |
| | | | | プット | | | | | | | | | | | | | | プット | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | 債 券 | : | | | | | | | | | | | | 債 券 | : | | | | | | | | | | | 債 券 | : | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 商 品 | : | | | | | | | | | | | | (新 設) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

| | | | | | | | | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| 新 | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | |

| | | | | | | | | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| 旧 | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | |

計算期間が6ヶ月以上のファンド

計算期間が6ヶ月以上のファンド

| 銘柄別 | コール プット 別 | 買 建 | | | | 売 建 | | | | 作成期末評価額 | | | |
|--------|-----------------|----------------------------|----------|------------|------------|------------|----------|------------|------------|----------|----------|-----------|-----|
| | | 新 規 買付額 | 決 済 額 | 権 利 行 使 | 権 利 放 棄 | 新 規 売付額 | 決 済 額 | 権 利 被行使 | 義 務 消 滅 | 買 建 額 | 売 建 額 | 評 価 損益 | |
| 国 内 | 株 式 | 日経225 コール プット | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| | | 日経300 | | | | | | | | | | | |
| | | 個別株 | | | | | | | | | | | |
| | 債 券 | : | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | |
| | 商 品 | : | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | |
| 外 国 | 株 式 | S & P 500 コール プット | | | | | | | | | | | |
| | | 個別株 | | | | | | | | | | | |
| | 債 券 | : | | | | | | | | | | | |

| 銘柄別 | コール プット 別 | 買 建 | | | | 売 建 | | | | 作成期末評価額 | | | |
|--------|-----------------|----------------------------|----------|------------|------------|------------|----------|------------|------------|----------|----------|-----------|-----|
| | | 新 規 買付額 | 決 済 額 | 権 利 行 使 | 権 利 放 棄 | 新 規 売付額 | 決 済 額 | 権 利 被行使 | 義 務 消 滅 | 買 建 額 | 売 建 額 | 評 価 損益 | |
| 国 内 | 株 式 | 日経 225 コール プット | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| | | 日経 300 | | | | | | | | | | | |
| | | 個別株 | | | | | | | | | | | |
| | 債 券 | : | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | |
| | (新 設) | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | |
| 外 国 | 株 式 | S & P 500 コール プット | | | | | | | | | | | |
| | | 個別株 | | | | | | | | | | | |
| | 債 券 | : | | | | | | | | | | | |

| 新 | | | | | | | | | | | | | |
|----|---|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| 商品 | : | | | | | | | | | | | | |
| : | : | | | | | | | | | | | | |

ロ．表示上の留意事項 (略)

(7) ~ (9) (略)

(10) 第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

イ．様式例

計算期間が6ヶ月未満のファンド

| 決算期 | 第 期 ~ 第 期 | | | | | |
|-----------------|------------|-------------|---------|------------|-------------|---------|
| | 買付 | | | 売付 | | |
| 区 分 | 買付額 (A) | うち自己取引状況(B) | (B)/(A) | 売付額 (C) | うち自己取引状況(D) | (D)/(C) |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 有価証券 | | | | | | |
| 店頭金融先物取引 | | | | | | |
| 商 品 | | | | | | |
| 商品先物取引 | | | | | | |
| 商品指数先物取引 | | | | | | |
| 商品指数オプション取引 | | | | | | |
| : | | | | | | |
| 上記に類似した外国市場での取引 | | | | | | |

| 旧 | | | | | | | | | | | | | |
|------|---|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|--|
| (新設) | : | | | | | | | | | | | | |
| : | : | | | | | | | | | | | | |

ロ．表示上の留意事項 (同 左)

(7) ~ (9) (同 左)

(10) 第一種金融商品取引業又は第二種金融商品取引業を兼業している投資信託委託会社の自己取引状況

イ．様式例

計算期間が6ヶ月未満のファンド

| 決算期 | 第 期 ~ 第 期 | | | | | |
|-----------------|------------|-------------|---------|------------|-------------|---------|
| | 買付 | | | 売付 | | |
| 区 分 | 買付額 (A) | うち自己取引状況(B) | (B)/(A) | 売付額 (C) | うち自己取引状況(D) | (D)/(C) |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 有価証券 | | | | | | |
| 店頭金融先物取引 | | | | | | |
| (新 設) | | | | | | |
| (新 設) | | | | | | |
| (新 設) | | | | | | |
| (新 設) | | | | | | |
| (新 設) | | | | | | |
| 上記に類似した外国市場での取引 | | | | | | |

| 新 | | | | | | |
|--|------------|-----------------|---------|------------|-----------------|---------|
| 計算期間が6ヶ月以上のファンド | | | | | | |
| 区 分 | 当 期 | | | | | |
| | 買 付 | | | 売 付 | | |
| | 買付額 (A) | うち自己取 引状況(B) | (B)/(A) | 売付額 (C) | うち自己取 引状況(D) | (D)/(C) |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 有価証券 | | | | | | |
| | | | | | | |
| 店頭金融先物取引 | | | | | | |
| 商 品 | | | | | | |
| 商品先物取引 | | | | | | |
| 商品指数先物取引 | | | | | | |
| 商品指数オプション取引 | | | | | | |
| ⋮ | | | | | | |
| 上記に類似した外国市場 での取引 | | | | | | |
| <p>□ . 表示上の留意事項 (略)</p> <p>(11) <u>委託会社による自社が設定する投資信託の受益証券又は投資法人の投資証券の自己取得及び処分の状況</u> (略)</p> <p>(12) 組入れ資産の明細 イ . 様式例 (イ) ~ (ル) (略) (ヲ) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細</p> | | | | | | |
| ファンド名 | 当 期 末 | | | | | |

| 旧 | | | | | | |
|--|------------|-----------------|---------|------------|-----------------|---------|
| 計算期間が6ヶ月以上のファンド | | | | | | |
| 区 分 | 当 期 | | | | | |
| | 買 付 | | | 売 付 | | |
| | 買付額 (A) | うち自己取 引状況(B) | (B)/(A) | 売付額 (C) | うち自己取 引状況(D) | (D)/(C) |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 有価証券 | | | | | | |
| | | | | | | |
| 店頭金融先物取引 | | | | | | |
| (新 設) | | | | | | |
| (新 設) | | | | | | |
| (新 設) | | | | | | |
| (新 設) | | | | | | |
| 上記に類似した外国市場 での取引 | | | | | | |
| <p>□ . 表示上の留意事項 (同 左)</p> <p>(11) <u>正会員の業務運営等に関する規則第6条の5に定める自社が設定する投資信託受益証券、投資証券の取得・処分状況</u> (同 左)</p> <p>(12) 組入れ資産の明細 イ . 様式例 (イ) ~ (ル) (同 左) (ヲ) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細</p> | | | | | | |
| ファンド名 | 当 期 末 | | | | | |

| 新 | | | |
|---------|-----|-----|----|
| | 単位数 | 評価額 | 比率 |
| 株式ファンド | 口 | 百万円 | % |
| 小計 | | | |
| 債券ファンド | | | |
| 小計 | | | |
| 不動産ファンド | | | |
| 小計 | | | |
| ⋮ | | | |
| 合計 | | | |

(注) 比率欄は純資産に対する比率。

(ワ) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| ファンド名 | 当期末 | | | 比率 |
|--------|-----|--------------|--------|----|
| | 単位数 | 評価額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| 株式ファンド | 口 | 千米ドル 千ポンド | 百万円 | % |

| 旧 | | | | |
|---------|-----|-----|----|--|
| | 単位数 | 評価額 | 比率 | |
| 株式ファンド | 口 | 百万円 | % | |
| 小計 | | | | |
| 債券ファンド | | | | |
| 小計 | | | | |
| 不動産ファンド | | | | |
| 小計 | | | | |
| (新設) | | | | |
| 合計 | | | | |

(注) 比率欄は純資産に対する比率。

(ワ) ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

| ファンド名 | 当期末 | | | 比率 |
|--------|-----|--------------|--------|----|
| | 単位数 | 評価額 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| 株式ファンド | 口 | 千米ドル 千ポンド | 百万円 | % |

| 新 | | | | |
|---------|--|--|--|--|
| 小 計 | | | | |
| 債券ファンド | | | | |
| 小 計 | | | | |
| 不動産ファンド | | | | |
| 小 計 | | | | |
| ⋮ | | | | |
| 合 計 | | | | |

| 旧 | | | | |
|---------|--|--|--|--|
| 小 計 | | | | |
| 債券ファンド | | | | |
| 小 計 | | | | |
| 不動産ファンド | | | | |
| 小 計 | | | | |
| (新 設) | | | | |
| 合 計 | | | | |

(注) 比率欄は純資産に対する比率。

(注) 比率欄は純資産に対する比率。

(カ) ~ (ソ) (略)

(カ) ~ (ソ) (同 左)

(ツ) 商品種類別期末残高

(新 設)

A 邦貨建商品

計算期間が6ヶ月未満のファンド

組入れ商品明細表

| 種類別 | 第 作成期末 | 第 作成期末 | |
|-----|--------|--------|-----|
| | 数 量 | 数 量 | 評価額 |
| 金 | | | 千円 |
| 小豆 | | | |
| ⋮ | | | |

| 新 | | | | | 旧 | | | | |
|----------------------------------|---------|--------------|--------|------------|-------------|--|--|--|--|
| 合計 | 金額 <比率> | — | — | < % > | | | | | |
| (注) 合計欄の < > 内は、純資産総額に対する評価額の比率。 | | | | | | | | | |
| 計算期間が6ヶ月以上のファンド | | | | | | | | | |
| 組入れ商品明細表 | | | | | | | | | |
| 種類別 | | 期 首 (前期末) | 当 期 末 | | | | | | |
| | | 数 量 | 数 量 | 評 価 額 | | | | | |
| 金 | | | | 千円 | | | | | |
| 小豆 | | | | | | | | | |
| : | | | | | | | | | |
| 合計 | 金額 <比率> | — | — | < % > | | | | | |
| (注) 合計欄の < > 内は、純資産総額に対する評価額の比率。 | | | | | | | | | |
| B 外貨建商品 | | | | | | | | | |
| 計算期間が6ヶ月未満のファンド | | | | | | | | | |
| 組入れ商品明細表 | | | | | | | | | |
| 種類別 | | 第 作成期 末 | 第 作成期末 | | | | | | |
| | | 数 量 | 数 量 | 評 価 額 | | | | | |
| | | | | 外貨建 金 額 | 邦貨換算 金 額 | | | | |
| (米 国) | | | | 千ドル | 千円 | | | | |
| 金 | | | | | | | | | |
| 小豆 | | | | | | | | | |
| : | | | | | | | | | |
| 小計 | 金額 <比率> | — | — | < % > | | | | | |

| 新 | | | | | 旧 | | | | |
|--|---------|-------------|-----|-----------|------------|--|--|-------|--|
| () | | | | | | | | | |
| 金 | | | | | | | | | |
| 小豆 | | | | | | | | | |
| : | | | | | | | | | |
| 小計 | 金額 <比率> | — | — | | | | | < % > | |
| 合計 | 金額 <比率> | — | — | | | | | < % > | |
| <p>(注1) 邦貨換算金額は期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。</p> <p>(注2) < > は純資産総額に対する各国別商品種類毎評価額の比率。</p> | | | | | | | | | |
| <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; display: inline-block;">計算期間が6ヶ月以上のファンド</div> | | | | | | | | | |
| 組入れ商品明細表 | | | | | | | | | |
| 種類別 | | 期首 (前期末) | 当期末 | | | | | | |
| | | 数量 | 数量 | 評価額 | | | | | |
| | | | | 外貨建 金額 | 邦貨換算 金額 | | | | |
| (米 国) | | | | 千ドル | 千円 | | | | |
| 金 | | | | | | | | | |
| 小豆 | | | | | | | | | |
| : | | | | | | | | | |
| 小計 | 金額 <比率> | — | — | | | | | < % > | |
| () | | | | | | | | | |
| 金 | | | | | | | | | |
| 小豆 | | | | | | | | | |
| : | | | | | | | | | |
| 小計 | 金額 <比率> | — | — | | | | | < % > | |
| 合計 | 金額 <比率> | — | — | | | | | < % > | |
| <p>(注1) 邦貨換算金額は期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により、邦貨換算したものです。</p> <p>(注2) < > は純資産総額に対する各国別商品評価額の比率。</p> | | | | | | | | | |

新

(ネ) 先物取引の銘柄別期末残高

組入有価証券明細表

| 銘柄別 | | 第 作成期末 | |
|-----|-------------|--------|-----|
| | | 買建額 | 売建額 |
| 国内 | 日 経 平 均 | 百万円 | 百万円 |
| | 日 経 3 0 0 | | |
| | T O P I X | | |
| | 株 先 5 0 | | |
| | 国 債 標 準 物 | | |
| | 通 貨 | | |
| | 商 品 | | |
| | | | |
| 外国 | S & P 5 0 0 | | |
| | 商 品 | | |
| | | | |

(注) 外貨建の評価額は、期末の時価を作成期末の仲値により、邦貨換算したものです。

(ナ) オプションの銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | | コール プット 別 | 第 作成期末 | |
|-----|-----|------------|-----------------|--------|-----|
| | | | | 買建額 | 売建額 |
| 国内 | 株 式 | 日 経 平 均 | コール プット | 百万円 | 百万円 |
| | | 日 経 3 0 0 | コール プット | | |
| | | T O P I X | コール プット | | |
| | 債 券 | コール プット | | | |

旧

(ツ) 先物取引の銘柄別期末残高

組入有価証券明細表

| 銘柄別 | | 第 作成期末 | |
|-----|-------------|--------|-----|
| | | 買建額 | 売建額 |
| 国内 | 日 経 平 均 | 百万円 | 百万円 |
| | 日 経 3 0 0 | | |
| | T O P I X | | |
| | 株 先 5 0 | | |
| | 国 債 標 準 物 | | |
| | 通 貨 | | |
| | (新 設) | | |
| | | | |
| 外国 | S & P 5 0 0 | | |
| | (新 設) | | |
| | | | |

(注) 外貨建の評価額は、期末の時価を作成期末の仲値により、邦貨換算したものです。

(ネ) オプションの銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | | コール プット 別 | 第 作成期末 | |
|-----|-----|------------|-----------------|--------|-----|
| | | | | 買建額 | 売建額 |
| 国内 | 株 式 | 日 経 平 均 | コール プット | 百万円 | 百万円 |
| | | 日 経 3 0 0 | コール プット | | |
| | | T O P I X | コール プット | | |
| | 債 券 | コール プット | | | |

| 新 | | | | | |
|--------|-----|------------|------------|--|--|
| 外 国 | 商 品 | | コール プット | | |
| | | | コール プット | | |
| | | | コール プット | | |
| | : | | コール プット | | |
| | | | コール プット | | |
| | 株 式 | S & P 500 | コール プット | | |
| | | | コール プット | | |
| | | | コール プット | | |
| | 債 券 | T - BOND | コール プット | | |
| | 商 品 | | コール プット | | |
| | | | コール プット | | |
| | : | | コール プット | | |
| | | コール プット | | | |

(注) 外貨建の評価額は、期末の時価を作成期末の仲値により、邦貨換算したものです。

(ラ) 個別株オプションの銘柄別期末残高

(略)

(ム) スワップ及び先渡取引残高

| 旧 | | | | | |
|--------|------|------------|------------|--|--|
| 外 国 | (新設) | | コール プット | | |
| | | | コール プット | | |
| | | | コール プット | | |
| | : | | コール プット | | |
| | | | コール プット | | |
| | 株 式 | S & P 500 | コール プット | | |
| | | | コール プット | | |
| | | | コール プット | | |
| | 債 券 | T - BOND | コール プット | | |
| | (新設) | | コール プット | | |
| | | | コール プット | | |
| | : | | コール プット | | |
| | | コール プット | | | |

(注) 外貨建の評価額は、期末の時価を作成期末の仲値により、邦貨換算したものです。

(ナ) 個別株オプションの銘柄別期末残高

(同 左)

(ラ) スワップ及び先渡取引残高

| 新 | | 旧 | |
|---|--------------|---|--------------|
| | 取引契約残高 | | 取引契約残高 |
| 種 類 | 第 期作成期末想定元本額 | 種 類 | 第 期作成期末想定元本額 |
| 金 利 | 百万円 | 金 利 | 百万円 |
| 通 貨 | | 通 貨 | |
| 金利先渡 | | 金利先渡 | |
| 為替先渡 | | 為替先渡 | |
| <u>商品先渡</u> | | <u>(新 設)</u> | |
| … | | … | |
| 合 計 | | 合 計 | |
| <p><u>(ウ)</u> 親投資信託残高 (略)</p> <p>□ . 表示上の留意事項 (イ) (略) (ロ) 表示の順序は、株式、新株予約権証券、オプション証券等、新株予約権付社債(転換社債)、公社債、投資信託受益証券及び投資証券、その他有価証券、金銭債権、約束手形、信託受益権、匿名組合出資持分、受益証券発行信託、<u>商品</u>、先物、オプション、スワップ、先渡取引、親投資信託の順とする。 (ハ) (略) (ニ) 主として新株予約権付社債(転換社債)を運用対象とするファンドについては、普通社債券とは別に、新株予約権付社債(転換社債)を銘柄別に表示する。新株予約権付社債(転換社債)を銘柄別に別途の区分で表示した場合は、<u>(リ)</u> 公社債におけるA債券種類別開示の(A)国内(邦貨建)及び(B)外国(外貨建)公社債表示例から新株予約権付社債(転換社債)を省略する。 (ホ)~(リ) (略) (ヌ) <u>(リ)</u> 公社債におけるA債券種類別開示の(注)について、当該比率が信託財産の状態を的確に表示することができなくなる可能性がある場合は、この限りではない。 なお、非上場債券については、各区分毎の内訳として表示することができる。 (ル) <u>(リ)</u> 公社債のB個別銘柄開示における(A)国内公社債の銘柄欄の債券の種類は、国債証券、地方債証券、特殊債券(除く金融債券)、金融債券、新株予</p> | | <p><u>(ム)</u> 親投資信託残高 (同 左)</p> <p>□ . 表示上の留意事項 (イ) (同 左) (ロ) 表示の順序は、株式、新株予約権証券、オプション証券等、新株予約権付社債(転換社債)、公社債、投資信託受益証券及び投資証券、その他有価証券、金銭債権、約束手形、信託受益権、匿名組合出資持分、受益証券発行信託、先物、オプション、スワップ、先渡取引、親投資信託の順とする。 (ハ) (同 左) (ニ) 主として新株予約権付社債(転換社債)を運用対象とするファンドについては、普通社債券とは別に、新株予約権付社債(転換社債)を銘柄別に表示する。新株予約権付社債(転換社債)を銘柄別に別途の区分で表示した場合は、<u>(ト)</u> 公社債におけるA債券種類別開示の(A)国内(邦貨建)及び(B)外国(外貨建)公社債表示例から新株予約権付社債(転換社債)を省略する。 (ホ)~(リ) (同 左) (ヌ) <u>(ト)</u> 公社債におけるA債券種類別開示の(注)について、当該比率が信託財産の状態を的確に表示することができなくなる可能性がある場合は、この限りではない。 なお、非上場債券については、各区分毎の内訳として表示することができる。 (ル) <u>(ト)</u> 公社債のB個別銘柄開示における(A)国内公社債の銘柄欄の債券の種類は、国債証券、地方債証券、特殊債券(除く金融債券)、金融債券、新株予</p> | |

| 新 | | | 旧 | | |
|---|-----------|-----|---|-----------|-----|
| <p>約権付債券(転換社債)、普通社債券(投資法人債券及び振替投資法人債を含む。)その他社債券の区分により行うこととする。</p> <p>(ヲ) (略)</p> <p>(ワ) ファンド・オブ・ファンズが組入れる投資信託証券(不動産投信を除く。)については、主要な投資対象につき組入れ有価証券等の明細を表示することとし、各投資信託毎に入手し得る直近の決算期分(半期決算及び四半期報告書等でも差し支えない。)により作成するものとする。ただし、この場合、投資した投資信託証券の報告書の該当部分の抜粋(上位銘柄、主要取引等)を表示することでもよい。また、運用報告書の表示項目の最後の「組入れ投資信託証券の内容」に表示しても構わない。</p> | | | <p>約権付債券(転換社債)、普通社債券(投資法人債券及び振替投資法人債を含む。)その他社債券の区分により行うこととする。</p> <p>(ヲ) (同左)</p> <p>(ワ) ファンド・オブ・ファンズが組入れる証券投資信託証券については、主要な投資対象につき組入れ有価証券等の明細を表示することとし、各投資信託毎に入手し得る直近の決算期分(半期決算及び四半期報告書等でも差し支えない。)により作成するものとする。ただし、この場合、投資した投資信託証券の報告書の該当部分の抜粋(上位銘柄、主要取引等)を表示することでもよい。また、運用報告書の表示項目の最後の「組入れ投資信託証券の内容」に表示しても構わない。</p> | | |
| (13) ~ (14) (略) | | | (13) ~ (14) (同左) | | |
| (16) 投資信託財産の構成 | | | (16) 投資信託財産の構成 | | |
| イ. 様式例 | | | イ. 様式例 | | |
| (イ) 直接投資ファンドの場合 | | | (イ) 直接投資ファンドの場合 | | |
| ○ 投資信託財産の構成 | | | ○ 投資信託財産の構成 | | |
| 年 月 日現在 | | | 年 月 日現在 | | |
| 項 目 | 第 作 成 期 末 | | 項 目 | 第 作 成 期 末 | |
| | 評 価 額 | 比 率 | | 評 価 額 | 比 率 |
| 株 式 | 千円 | % | 株 式 | 千円 | % |
| 新株予約権証券 | | | 新株予約権証券 | | |
| オプション証券等 | | | オプション証券等 | | |
| 新株予約権付社債(転換社債) | | | 新株予約権付社債(転換社債) | | |
| 公 社 債 | | | 公 社 債 | | |
| 投資信託受益証券 | | | 投資信託受益証券 | | |
| その他有価証券 | | | その他有価証券 | | |
| … | | | (新設) | | |
| 商 品 | | | (新設) | | |
| … | | | … | | |

| 新 | | | | 旧 | | | |
|---|------|-------|-----------------|---|------|-------|-----------------|
| コール・ローン等、その他 | | | | コール・ローン等、その他 | | | |
| 投資信託財産総額 | | 100.0 | | 投資信託財産総額 | | 100.0 | |
| (注1)～(注2) (略) | | | | (注1)～(注2) (同左) | | | |
| (ロ)間接投資ファンドの場合 (略) | | | | (ロ)間接投資ファンドの場合 (同左) | | | |
| ロ．表示上の留意事項 | | | | ロ．表示上の留意事項 | | | |
| (イ)組入資産は、株式、新株予約権証券、オプション証券等、新株予約権付社債(転換社債)、公社債、投資信託受益証券及び投資証券、その他有価証券、金銭債権、約束手形、信託受益権、匿名組合出資持分、受益証券発行信託、 <u>商品</u> 、親投資信託受益証券に分けて表示する。 | | | | (イ)組入資産は、株式、新株予約権証券、オプション証券等、新株予約権付社債(転換社債)、公社債、投資信託受益証券及び投資証券、その他有価証券、金銭債権、約束手形、信託受益権、匿名組合出資持分、受益証券発行信託、親投資信託受益証券に分けて表示する。 | | | |
| (ロ)～(チ) (略) | | | | (ロ)～(チ) (同左) | | | |
| (18) 資産、負債、元本及び基準価額の状況並びに損益の状況 | | | | (18) 資産、負債、元本及び基準価額の状況並びに損益の状況 | | | |
| イ．表示例 | | | | イ．表示例 | | | |
| (イ) 単位型投資信託 | | | | (イ) 単位型投資信託 | | | |
| <div style="border: 1px solid black; padding: 2px; display: inline-block;">計算期間が6ヶ月未満のファンド</div> | | | | <div style="border: 1px solid black; padding: 2px; display: inline-block;">計算期間が6ヶ月未満のファンド</div> | | | |
| 資産、負債、元本及び基準価額の状況 | | | | 資産、負債、元本及び基準価額の状況 | | | |
| (年 月 日) (年 月 日) 現在 | | | | (年 月 日) (年 月 日) 現在 | | | |
| 項 目 | 第 期末 | 第 期末 | 償還の場合は 〔償還時〕 | 項 目 | 第 期末 | 第 期末 | 償還の場合は 〔償還時〕 |
| | 円 | 円 | | | 円 | 円 | |
| (A) 資産 | | | | (A) 資産 | | | |
| コール・ローン等 | | | | コール・ローン等 | | | |
| 株式 (評価額) | | | | 株式 (評価額) | | | |
| 新株予約権証券 (評価額) | | | | 新株予約権証券 (評価額) | | | |
| オプション証券等 (評価額) | | | | オプション証券等 (評価額) | | | |
| 公社債 (評価額) | | | | 公社債 (評価額) | | | |
| 投資信託受益証券 (評価額) | | | | 投資信託受益証券 (評価額) | | | |
| <u>商品</u> (評価額) | | | | (新設) | | | |
| ⋮ | | | | ⋮ | | | |
| 号株式ファンド (評価額) | | | | 号株式ファンド (評価額) | | | |
| 号公社債ファンド (評価額) | | | | 号公社債ファンド (評価額) | | | |
| コールオプション (買) | | | | コールオプション (買) | | | |
| プットオプション (買) | | | | プットオプション (買) | | | |

| 新 | | 旧 | |
|---|---|---|---|
| 未収入金 未収配当金 未収利息 前払費用 その他未収収益 差入保証金 差入委託証拠金 ： | | | |
| (B) 負債 コールオプション (売) プットオプション (売) 借入金 未払金 未払株式払込金 未払収益分配金 未払解約金 未払信託報酬 未払利息 その他未払費用 ： | | | |
| (C) 純資産総額(注) 元 本 次期繰越損益金 〔償還差損益金〕 | | | |
| (D) 受益権総口数 | □ | □ | |
| 1口当り基準価額(C/D) | 円 | 円 | |
| 〔1口当り償還価額(C/D)〕 | - | 円 | 銭 |

(注) 資産(A) - 負債(B) に先物取引等評価損益(×××円)を加算する。

計算期間が6ヶ月以上のファンド

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(年月日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-------|
| (A) 資 産 | 円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | |
| 株 式 (評価額) | |
| 新株予約権証券 (評価額) | |
| オプション証券等 (評価額) | |

償還の場合は
〔償還時〕

| 新 | | 旧 | |
|---|---|---|---|
| 未収入金 未収配当金 未収利息 前払費用 その他未収収益 差入保証金 差入委託証拠金 ： | | | |
| (B) 負債 コールオプション (売) プットオプション (売) 借入金 未払金 未払株式払込金 未払収益分配金 未払解約金 未払信託報酬 未払利息 その他未払費用 ： | | | |
| (C) 純資産総額(注) 元 本 次期繰越損益金 〔償還差損益金〕 | | | |
| (D) 受益権総口数 | □ | □ | |
| 1口当り基準価額(C/D) | 円 | 円 | |
| 〔1口当り償還価額(C/D)〕 | - | 円 | 銭 |

(注) 資産(A) - 負債(B) に先物取引等評価損益(×××円)を加算する。

計算期間が6ヶ月以上のファンド

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(年月日)現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-------|
| (A) 資 産 | 円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | |
| 株 式 (評価額) | |
| 新株予約権証券 (評価額) | |
| オプション証券等 (評価額) | |

償還の場合は
〔償還時〕

| 新 | | 旧 | |
|---|-----|---|-------|
| 公 社 債 (評価額) 投資信託受益証券 (評価額) 商 品 (評価額) …… 号株式ファンド (評価額) 号公社債ファンド (評価額) コールオプション (買) プットオプション (買) 未 収 入 金 未 収 配 当 金 未 収 利 息 前 払 費 用 その他未収収益 差 入 保 証 金 差 入 委 託 証 拠 金 …… (B) 負 債 コールオプション (売) プットオプション (売) 借 入 金 未 払 金 未 払 株 式 払 込 金 未 払 収 益 分 配 金 未 払 解 約 金 未 払 信 託 報 酬 未 払 利 息 その他未払費用 …… (C) 純資産総額 (注) 元 本 次 期 繰 越 損 益 金 [償 還 差 損 益 金] (D) 受益権総口数 口 1口当り基準価額 (C/D) 円 [1口当り償還価額 (C/D)] 銭 | | 公 社 債 (評価額) 投資信託受益証券 (評価額) (新 設) …… 号株式ファンド (評価額) 号公社債ファンド (評価額) コールオプション (買) プットオプション (買) 未 収 入 金 未 収 配 当 金 未 収 利 息 前 払 費 用 その他未収収益 差 入 保 証 金 差 入 委 託 証 拠 金 …… (B) 負 債 コールオプション (売) プットオプション (売) 借 入 金 未 払 金 未 払 株 式 払 込 金 未 払 収 益 分 配 金 未 払 解 約 金 未 払 信 託 報 酬 未 払 利 息 その他未払費用 …… (C) 純資産総額 (注) 元 本 次 期 繰 越 損 益 金 [償 還 差 損 益 金] (D) 受益権総口数 口 1口当り基準価額 (C/D) 円 [1口当り償還価額 (C/D)] 銭 | |
| (注) 資産(A) - 負債(B) に先物取引等評価損益 (× × × 円) を加算する。 | | (注) 資産(A) - 負債(B) に先物取引等評価損益 (× × × 円) を加算する。 | |
| 損益の状況 | (略) | 損益の状況 | (同 左) |

| 新 | | | | 旧 | | | |
|------------------------|------|------|-----------------|------------------------|------|------|-----------------|
| (口) 追加型投資信託 | | | | (口) 追加型投資信託 | | | |
| 計算期間が6ヶ月未満のファンド | | | | 計算期間が6ヶ月未満のファンド | | | |
| 資産、負債、元本及び基準価額の状況 | | | | 資産、負債、元本及び基準価額の状況 | | | |
| (年 月 日) (年 月 日) 現在 | | | | (年 月 日) (年 月 日) 現在 | | | |
| 項 目 | 第 期末 | 第 期末 | 償還の場合は 〔償還時〕 | 項 目 | 第 期末 | 第 期末 | 償還の場合は 〔償還時〕 |
| | 円 | 円 | | | 円 | 円 | |
| (A) 資産 | | | | (A) 資産 | | | |
| コール・ローン等 株 式 (評価額) | | | | コール・ローン等 株 式 (評価額) | | | |
| 新株予約権証券 (評価額) | | | | 新株予約権証券 (評価額) | | | |
| オプション証券等 (評価額) | | | | オプション証券等 (評価額) | | | |
| 公 社 債 (評価額) | | | | 公 社 債 (評価額) | | | |
| 出 資 証 券 (評価額) | | | | 出 資 証 券 (評価額) | | | |
| 投資信託受益証券 (評価額) | | | | 投資信託受益証券 (評価額) | | | |
| その他有価証券 (評価額) | | | | その他有価証券 (評価額) | | | |
| 商 品 (評価額) | | | | (新 設) | | | |
| ... | | | | ... | | | |
| コールオプション(買) | | | | コールオプション(買) | | | |
| プットオプション(買) | | | | プットオプション(買) | | | |
| 未 収 入 金 | | | | 未 収 入 金 | | | |
| 未 収 配 当 金 | | | | 未 収 配 当 金 | | | |
| 未 収 利 息 | | | | 未 収 利 息 | | | |
| 前 払 費 用 | | | | 前 払 費 用 | | | |
| そ の 他 未 収 収 益 | | | | そ の 他 未 収 収 益 | | | |
| 差 入 保 証 金 | | | | 差 入 保 証 金 | | | |
| 差 入 委 託 証 拠 金 | | | | 差 入 委 託 証 拠 金 | | | |
| ... | | | | ... | | | |
| (B) 負債 | | | | (B) 負債 | | | |
| コールオプション(売) | | | | コールオプション(売) | | | |
| プットオプション(売) | | | | プットオプション(売) | | | |
| 借 入 金 | | | | 借 入 金 | | | |
| 未 払 金 | | | | 未 払 金 | | | |
| 未 払 株 式 払 込 金 | | | | 未 払 株 式 払 込 金 | | | |
| 未 払 収 益 分 配 金 | | | | 未 払 収 益 分 配 金 | | | |
| 未 払 解 約 金 | | | | 未 払 解 約 金 | | | |
| 未 払 信 託 報 酬 | | | | 未 払 信 託 報 酬 | | | |

| 新 | | | | 旧 | | | |
|---|---|---|--------------------------------------|---|---|---|--------------------------------------|
| 未払利息 差入保証金代用有価証券 差入委託証拠金代用有価証券 その他未払費用 ⋮ (C) 純資産総額 (A)-(B) 元 本 次期繰越損益金 (D) 受益権総口数 1口当り基準価額 (C/D) 〔1口当り償還価額 (C/D)〕 | □ | □ | 1口1円の場合 (C/D、基準 価額を表示す る単位) | 未払利息 差入保証金代用有価証券 差入委託証拠金代用有価証券 その他未払費用 ⋮ (C) 純資産総額 (A)-(B) 元 本 次期繰越損益金 (D) 受益権総口数 1口当り基準価額 (C/D) 〔1口当り償還価額 (C/D)〕 | □ | □ | 1口1円の場合 (C/D、基準 価額を表示す る単位) |

計算期間が6ヶ月以上のファンド

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(年 月 日) 現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|---|-------|
| (A) 資 産 | 円 |
| コール・ローン等 株 式 (評価額) 新株予約権証券 (評価額) オプション証券等 (評価額) 公 社 債 (評価額) 出 資 証 券 (評価額) 投資信託受益証券 (評価額) その他有価証券 (評価額) 商 品 (評価額) ⋮ コールオプション (買) プットオプション (買) 未 収 入 金 未 収 配 当 金 未 収 利 息 前 払 費 用 そ の 他 未 収 収 益 金 差 入 保 証 金 | |

償還の場合は
〔償還時〕

計算期間が6ヶ月以上のファンド

資産、負債、元本及び基準価額の状況

(年 月 日) 現在

| 項 目 | 当 期 末 |
|---|-------|
| (A) 資 産 | 円 |
| コール・ローン等 株 式 (評価額) 新株予約権証券 (評価額) オプション証券等 (評価額) 公 社 債 (評価額) 出 資 証 券 (評価額) 投資信託受益証券 (評価額) その他有価証券 (評価額) (新 設) ⋮ コールオプション (買) プットオプション (買) 未 収 入 金 未 収 配 当 金 未 収 利 息 前 払 費 用 そ の 他 未 収 収 益 金 差 入 保 証 金 | |

償還の場合は
〔償還時〕

| 新 | | 旧 | | |
|---|--|--------------------------------------|---|--------------------------------------|
| 差入委託証拠金 … (B) 負債 コールオプション(売) プットオプション(売) 借入金 未払金 未払株式払込金 未払収益分配金 未払解約金 未払信託報酬 未払利息 差入保証金代用有価証券 差入委託証拠金代用有価証券 その他未払費用 … (C) 純資産総額(A)-(B) 元 本 次期繰越損益金 (D) 受益権総口数 口 1口当り基準価額(C/D) 円 [1口当り償還価額(C/D)] 銭 | | 1口1円の場合 (C/D、基準 価額を表示す る単位) | 差入委託証拠金 … (B) 負債 コールオプション(売) プットオプション(売) 借入金 未払金 未払株式払込金 未払収益分配金 未払解約金 未払信託報酬 未払利息 差入保証金代用有価証券 差入委託証拠金代用有価証券 その他未払費用 … (C) 純資産総額(A)-(B) 元 本 次期繰越損益金 (D) 受益権総口数 口 1口当り基準価額(C/D) 円 [1口当り償還価額(C/D)] 銭 | 1口1円の場合 (C/D、基準 価額を表示す る単位) |
| (以下略) | | (同左) | | |
| 附 則 この改正は、平成21年1月16日より実施する。 | | | | |