

【表紙】

| | |
|--------------------------------------|-----------------------------|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書の訂正届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長殿 |
| 【提出日】 | 平成26年2月18日 |
| 【発行者名】 | ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役社長 関崎 司 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都千代田区永田町二丁目11番1号 山王パークタワー |
| 【事務連絡者氏名】 | 出仙 学恭 |
| 【電話番号】 | 03(5156)5000 |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】 | ドイチェ・ロシア東欧株式ファンド |
| 【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】 | 1兆円を上限とします。 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書の提出に伴い、平成25年8月20日付をもって提出した有価証券届出書の関係情報を新たな情報により訂正するため、また、記載事項の一部訂正を行うため本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

下線部 _____ は訂正部分を示します。

第一部【証券情報】

(5)【申込手数料】

<訂正前>

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.675%（税抜3.5%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細については、販売会社または委託会社の後記照会先にお問合せ下さい。

収益分配金を再投資する場合の申込手数料は無手数料とします。

<訂正後>

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.675%^{*}（税抜3.5%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。

申込手数料の詳細については、販売会社にお問合せ下さい。

収益分配金を再投資する場合の申込手数料は無手数料とします。

* 消費税率が8%になった場合は、3.78%となります。

(6)【申込単位】

<訂正前>

申込単位は、販売会社が定める単位とします。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。

申込単位の詳細については、販売会社または委託会社の後記照会先にお問合せ下さい。

<訂正後>

申込単位は、販売会社が定める単位とします。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。

申込単位の詳細については、販売会社にお問合せ下さい。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

（前略）

ファンドの特色

（中略）

1. ロシア・東欧諸国（トルコ・ポーランド・ハンガリー・チェコ）の株式を主要投資対象とし、それらの国々の成長を捉えた運用の実現を目指します。

ロシア・東欧諸国（トルコ・ポーランド・ハンガリー・チェコ）を、以下総称して「主要投資対象国」ということがあります。

主要投資対象国に加え、ウクライナ、エストニア、オーストリア、カザフスタン、グルジア、スロバキア、ブルガリア、ラトビア、リトアニア、ルーマニア（以下総称して「その他投資対象国」ということがあります。）にも投資する場合があります。また、主要投資対象国及びその他投資対象国以外の国にも、DWSインベストメントGmbHが実質的に主要投資対象国及びその他投資対象国に該当すると判断する場合には、投資することがあります。（2013年6月末現在）

投資対象には預託証書等が含まれます。

2. マザーファンドに係る運用指図に関する権限を、DWSインベストメントGmbHに委託します。

DWSインベストメントGmbHはドイツ銀行グループのアセット&ウェルス・マネジメント部門のドイツにおける拠点です。グローバルなネットワークを駆使し、投資家の多様なニーズに応える商品開発と優れた運用実績の実現を目指します。

(以下略)

<訂正後>

(前略)

ファンドの特色

(中略)

1. ロシア・東欧諸国(トルコ・ポーランド・ハンガリー・チェコ)の株式を主要投資対象とし、それらの国々の成長を捉えた運用の実現を目指します。

ロシア・東欧諸国(トルコ・ポーランド・ハンガリー・チェコ)を、以下総称して「主要投資対象国」ということがあります。

主要投資対象国に加え、ウクライナ、エストニア、オーストリア、カザフスタン、グルジア、スロバキア、ブルガリア、ラトビア、リトアニア、ルーマニア(以下総称して「その他投資対象国」ということがあります。)にも投資する場合があります。また、主要投資対象国及びその他投資対象国以外の国にも、ドイチェ・アセット&ウェルス・マネジメント・インベストメントGmbHが実質的に主要投資対象国及びその他投資対象国に該当すると判断する場合には、投資することがあります。

(2013年12月末現在)

投資対象には預託証券等が含まれます。

2. マザーファンドに係る運用指図に関する権限を、ドイチェ・アセット&ウェルス・マネジメント・インベストメントGmbHに委託します。

ドイチェ・アセット&ウェルス・マネジメント・インベストメントGmbHはドイツ銀行グループのアセット&ウェルス・マネジメント部門のドイツにおける拠点です。グローバルなネットワークを駆使し、投資家の多様なニーズに応える商品開発と優れた運用実績の実現を目指します。

(以下略)

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

(前略)

委託会社及びファンドの関係法人

(中略)

d. DWSインベストメントGmbH(「投資顧問会社」)

(中略)

委託会社の概況

a. 資本金の額(2013年6月末現在)

(中略)

c. 大株主の状況(2013年6月末現在)

(以下略)

<訂正後>

(前略)

委託会社及びファンドの関係法人

(中略)

d. ドイチェ・アセット&ウェルス・マネジメント・インベストメントGmbH(「投資顧問会社」)

(中略)

委託会社の概況

- a . 資本金の額（2013年12月末現在）
（中略）
- c . 大株主の状況（2013年12月末現在）
（以下略）

2【投資方針】

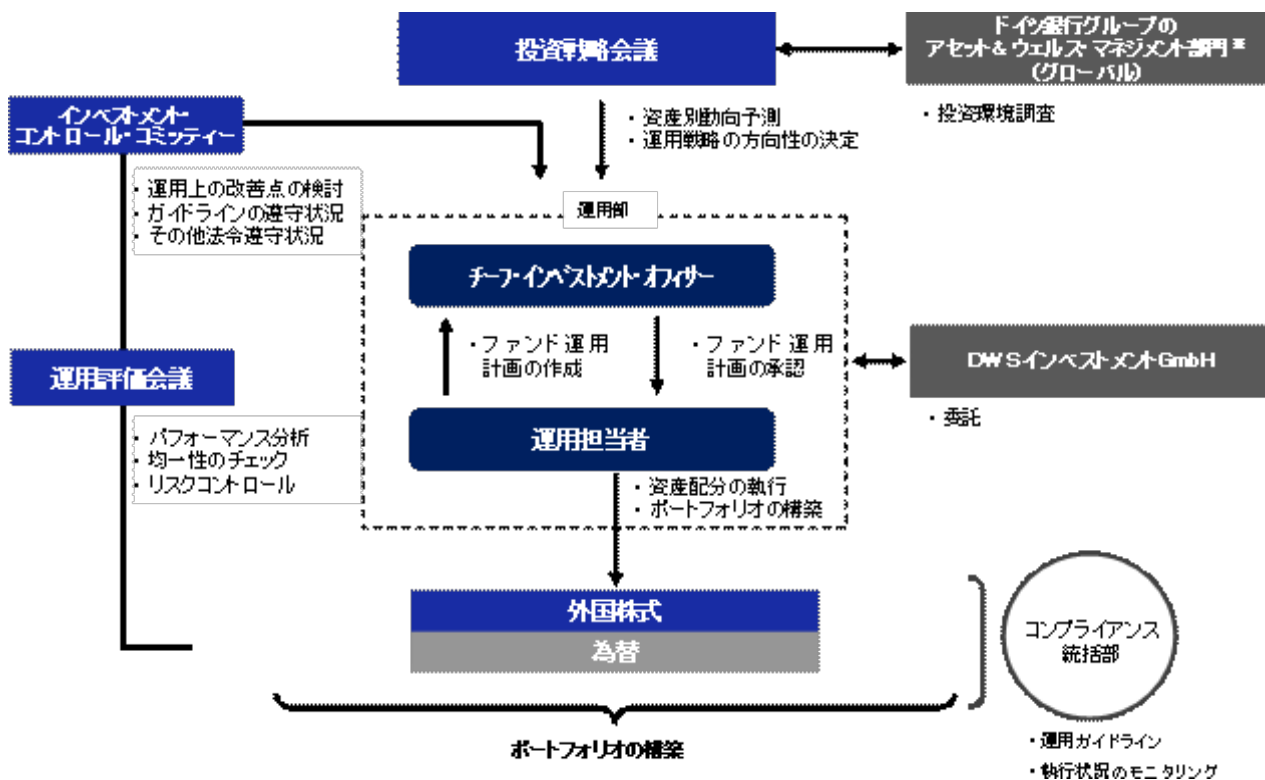
(3)【運用体制】

< 訂正前 >

ファンドの運用体制

当ファンドの運用体制は以下の通りです。

< 運用体制 >

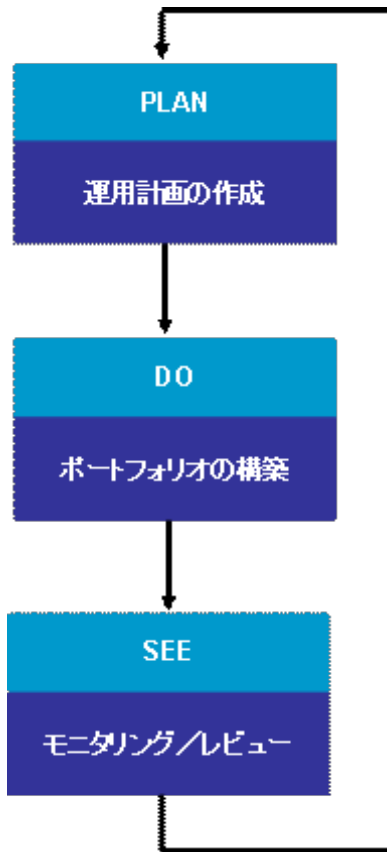


ドイツ銀行グループにおける資産運用ビジネスを担います。

委託会社は、マザーファンドに係る運用指図に関する権限をDWSインベストメントGmbH（所在地：ドイツ フランクフルト）に委託します（以下「運用委託先」という場合があります。）。運用計画の作成、法令等の遵守状況確認、運用評価及びリスク管理等のその他運用に関連する業務は、委託会社の運用部が行います。当該運用部における主な意思決定機関は、投資戦略会議、運用評価会議、インベストメント・コントロール・コミッティーの3つがあります。これらはいずれもチーフ・インベストメント・オフィサーが主催し、各運用担当者及び必要に応じて関係部署の代表者が参加して行われます。

（中略）

< 運用の流れ >



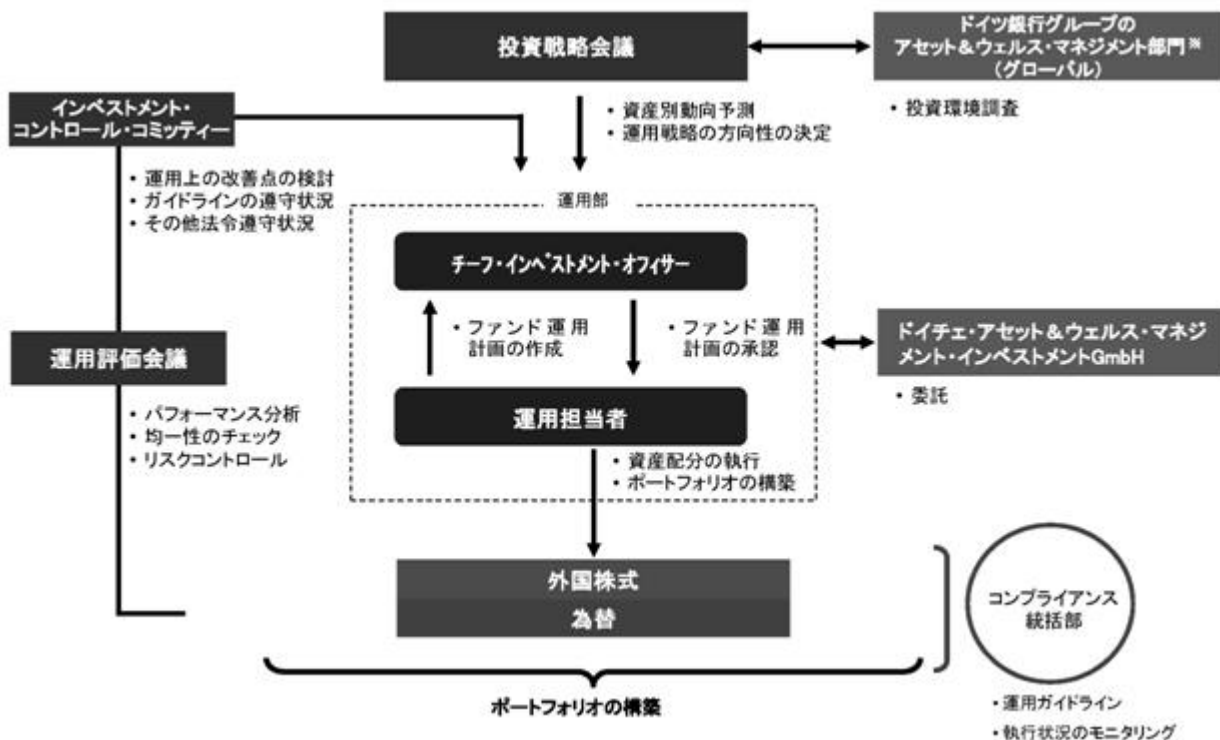
- 運用計画の作成にあたっては、グローバルに展開するドイツ銀行グループの資産&ウェルス・マネジメント部門内で情報交換を行い、世界の投資環境について分析を行います。
- 投資戦略会議において、各投資対象についての大きな運用方針を決定します。
- 運用担当者は、投資戦略会議の方針にしたがってファンドの運用計画を作成し、チーフ・インベストメント・オフィサーの承認を得ます。
- 承認された運用計画にしたがって、ポートフォリオの構築を行います。
- 運用業務管理等の社内規程に則り、ポートフォリオの管理を行います。
- 個々の投資判断については、必要に応じて、DWSインベストメントGmbHに所属する運用チームへ委託を行います。
- コンプライアンス統括部が、個々の売買についてガイドライン違反等がないかチェックを行います。
- 運用評価会議では、ファンドの運用成績を分析するとともに、リスク管理の状況や他ファンドとの均一性などについてレビューを行います。
- インベストメント・コントロール・コミッティーにおいて、ガイドラインの遵守状況や運用上の改善すべき点などについて検討を行います。

（以下略）

<訂正後>

当ファンドの運用体制は以下の通りです。

<運用体制>

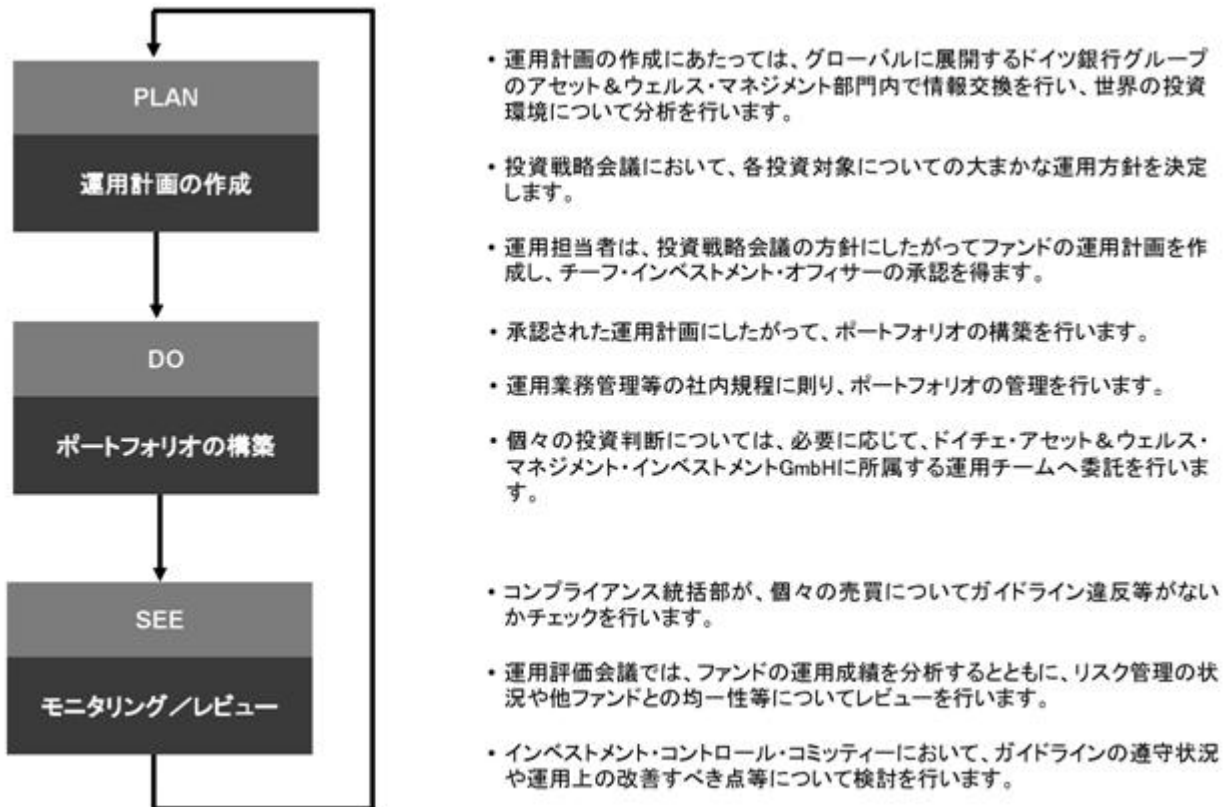


ドイツ銀行グループにおける資産運用ビジネスを担います。

委託会社は、マザーファンドに係る運用指図に関する権限をドイチェ・アセット&ウェルス・マネジメント・インベストメントGmbH（所在地：ドイツ フランクフルト）に委託します（以下「運用委託先」という場合があります。）。運用計画の作成、法令等の遵守状況確認、運用評価及びリスク管理等のその他運用に関連する業務は、委託会社の運用部が行います。当該運用部における主な意思決定機関は、投資戦略会議、運用評価会議、インベストメント・コントロール・コミッティーの3つがあります。これらはいずれもチーフ・インベストメント・オフィサーが主催し、各運用担当者及び必要に応じて関係部署の代表者が参加して行われます。

（中略）

<運用の流れ>



（以下略）

3【投資リスク】

<訂正前>

(1) 当ファンドの主なリスク及び留意点

（中略）

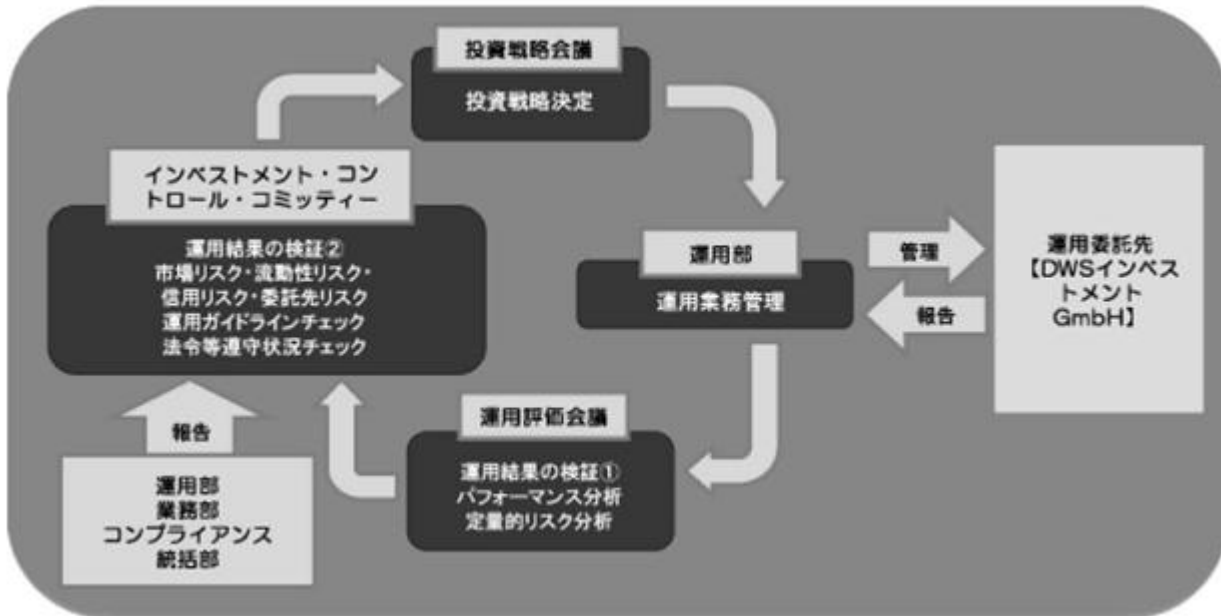
その他の留意点

- ロシア株式への直接投資にあたっては、現地の法制度の制約により、証券の保管が日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社（株式会社りそな銀行（受託会社）の再信託受託会社）名義による混蔵保管となります。また、石油等の資源株については、外国人保有株数制限が課されております。当ファンド単独では上限を超過していない場合でも、当該制限を受けることがあります。（2013年6月末現在）

（中略）

(2) 投資リスクに対する管理体制

委託会社のリスク管理体制は以下の通りです。



（以下略）

<訂正後>

(1) 当ファンドの主なリスク及び留意点

（中略）

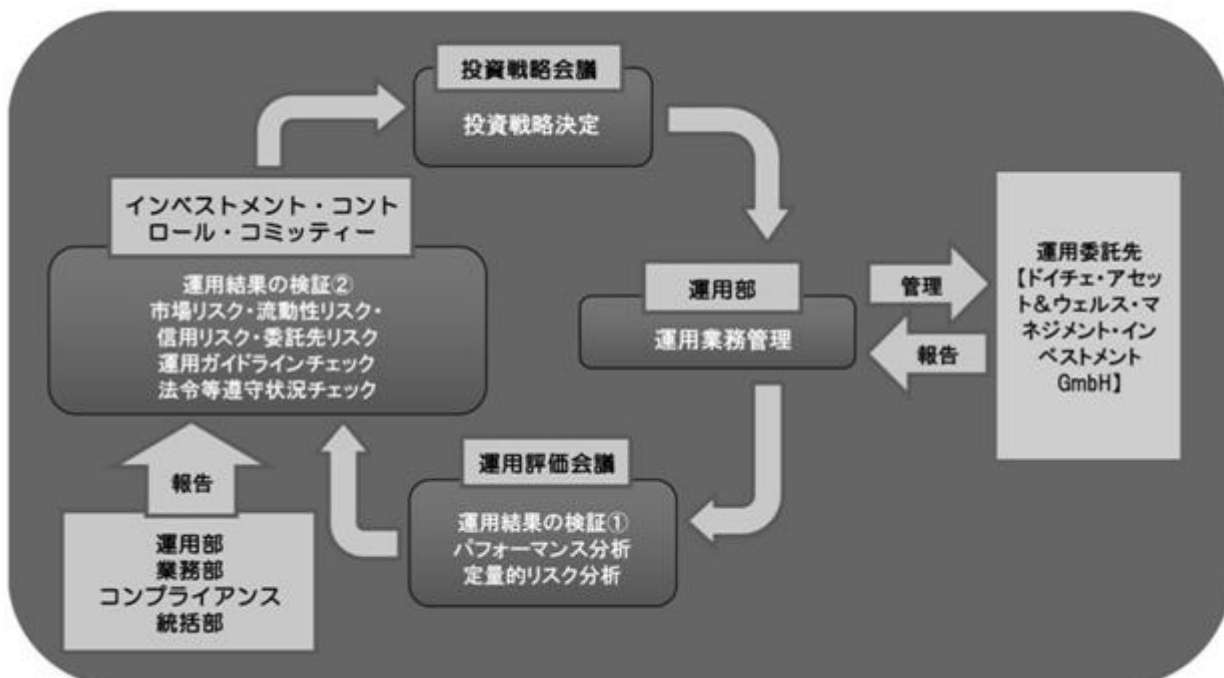
その他の留意点

- ・ロシア株式への直接投資にあたっては、現地の法制度の制約により、証券の保管が日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社（株式会社りそな銀行（受託会社）の再信託受託会社）名義による混蔵保管となります。また、石油等の資源株については、外国人保有株数制限が課されております。当ファンド単独では上限を超過していない場合でも、当該制限を受けることがあります。（2013年12月末現在）

（中略）

(2) 投資リスクに対する管理体制

委託会社のリスク管理体制は以下の通りです。



（以下略）

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

<訂正前>

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.675%（税抜3.5%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料の詳細については、販売会社または委託会社の下記照会先にお問合せ下さい。

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社

・ホームページアドレス <http://www.damj.co.jp/>

・フリーダイヤル 0120-442-785（受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで）

収益分配金を再投資する場合の申込手数料は無手数料とします。

<訂正後>

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.675%^{*}（税抜3.5%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料の詳細については、販売会社にお問合せ下さい。

収益分配金を再投資する場合の申込手数料は無手数料とします。

* 消費税率が8%になった場合は、3.78%となります。

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.974%（税抜1.88%）を乗じて得た額とし、その配分は以下の通りとします。

（年率）

| 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 | 合計 |
|-----------|-----------|-----------|-----------|
| 0.945% | 0.945% | 0.084% | 1.974% |
| （税抜0.90%） | （税抜0.90%） | （税抜0.08%） | （税抜1.88%） |

（注）委託会社及び受託会社の報酬は、ファンドから支払われます。信託報酬の販売会社への配分は、販売会社が行うファンドの募集の取扱い等に関する業務に対する代行手数料であり、ファンドから委託会社に支払われた後、委託会社より販売会社に対して支払われます。

上記の信託報酬並びに当該信託報酬に係る消費税及び地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）を毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

マザーファンドの運用指図を行うDWSインベストメントGmbHに対する投資顧問報酬は、委託会社が受ける信託報酬の中から支払われます。

<訂正後>

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.974%^{*}（税抜1.88%）を乗じて得た額とし、その配分は以下の通りとします。

（年率、税抜）

| 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 |
|-------|-------|-------|
| 0.90% | 0.90% | 0.08% |

（注）委託会社及び受託会社の報酬は、ファンドから支払われます。信託報酬の販売会社への配分は、販売会社が行うファンドの募集の取扱い等に関する業務に対する代行手数料であり、ファンドから委託会社に支払われた後、委託会社より販売会社に対して支払われます。

* 消費税率が8%になった場合は、年率2.0304%となります。

上記の信託報酬並びに当該信託報酬に係る消費税及び地方消費税に相当する金額（以下「消費税等相当額」といいます。）を毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

マザーファンドの運用指図を行うドイチェ・アセット&ウェルス・マネジメント・インベストメントGmbHに対する投資顧問報酬は、委託会社が受ける信託報酬の中から支払われます。

(5)【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

(前略)

課税の取扱いについて

以下の内容は平成25年6月末現在の税法に基づくものであり、税法が改正された場合等には内容が変更されることがあります。

a . 個人の受益者に対する課税

収益分配金の取扱い

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、原則として10.147%（所得税7.147%及び地方税3%）¹の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行い、総合課税または申告分離課税を選択することもできます。

一部解約金、償還金の取扱い

一部解約時及び償還時の差益については譲渡所得となり、原則として10.147%（所得税7.147%及び地方税3%）¹の税率による申告分離課税が適用されます。なお、特定口座において「源泉徴収あり」を選択した場合には、10.147%（所得税7.147%及び地方税3%）¹の税率による源泉徴収が行われます。

(中略)

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。（平成26年1月1日以降）

(中略)

b . 法人の受益者に対する課税

収益分配金、一部解約金、償還金の取扱い

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、7.147%（所得税のみ）²の税率で源泉徴収され、法人の受取額となります。なお、地方税の源泉徴収はありません。

(中略)

1 税率は、平成26年1月1日から平成49年12月31日までは20.315%（所得税15.315%及び地方税5%）となる予定です。

2 税率は、平成26年1月1日から平成49年12月31日までは15.315%（所得税のみ）となる予定です。

(注1) 上記のほか、販売会社によっては、受益権を買い取る場合があります。買取請求時の課税の取扱いについて、詳しくは、販売会社にお問合せ下さい。

(注2) 課税上の取扱いの詳細については、税務専門家または税務署にご確認下さい。

< 訂正後 >

(前略)

課税の取扱いについて

以下の内容は平成26年1月1日現在の税法に基づくものであり、税法が改正された場合等には内容が変更されることがあります。

a . 個人の受益者に対する課税

収益分配金の取扱い

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、原則として20.315%（所得税15.315%及び地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行い、総合課税または申告分離課税を選択することもできます。

一部解約金、償還金の取扱い

一部解約時及び償還時の差益については譲渡所得となり、原則として20.315%（所得税15.315%及び地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。なお、特定口座において「源泉徴収あり」を選択した場合には、20.315%（所得税15.315%及び地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。

(中略)

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度の適用対象です。

(中略)

b. 法人の受益者に対する課税

収益分配金、一部解約金、償還金の取扱い

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金並びに一部解約時及び償還時の個別元本超過額については、15.315% (所得税のみ)の税率で源泉徴収され、法人の受取額となります。なお、地方税の源泉徴収はありません。

(中略)

(注1) 上記のほか、販売会社によっては、受益権を買い取る場合があります。買取請求時の課税の取扱いについて、詳しくは、販売会社にお問合せ下さい。

(注2) 課税上の取扱いの詳細については、税務専門家または税務署にご確認下さい。

5【運用状況】

本項を以下の記載内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

(1)【投資状況】

「ドイチェ・ロシア東欧株式ファンド」

(平成25年12月30日現在)

| 資産の種類 | 地域別(国名) | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------------|---------|----------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 10,637,768,367 | 100.40 |
| コール・ローン・その他の資産 (負債控除後) | - | 42,860,412 | 0.40 |
| 合計(純資産総額) | - | 10,594,907,955 | 100.00 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(参考情報)

「東欧株式マザーファンド」

(平成25年12月30日現在)

| 資産の種類 | 地域別(国名) | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|---------------------------|----------|----------------|----------------|
| 株式 | オランダ | 175,503,859 | 1.38 |
| | オーストリア | 74,468,670 | 0.59 |
| | トルコ | 1,328,633,811 | 10.46 |
| | チェコ | 332,286,675 | 2.62 |
| | キプロス | 613,053,630 | 4.83 |
| | ハンガリー | 73,815,840 | 0.58 |
| | ポーランド | 1,295,065,907 | 10.20 |
| | ポルトガル | 257,826,375 | 2.03 |
| | ロシア | 7,766,554,687 | 61.15 |
| | ケイマン | 58,653,961 | 0.46 |
| | ルーマニア | 40,398,832 | 0.32 |
| | 英ヴァージン諸島 | 86,291,727 | 0.68 |
| | マン島 | 4,235,476 | 0.03 |
| | 小計 | | 12,106,789,450 |
| 社債券 | ハンガリー | 81,717,298 | 0.64 |
| | 小計 | | 81,717,298 |
| 投資証券 | トルコ | 60,159,300 | 0.47 |
| | 小計 | | 60,159,300 |
| コール・ローン・その他の資産 (負債控除後) | - | 451,697,127 | 3.56 |
| 合計(純資産総額) | - | 12,700,363,175 | 100.00 |

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

「ドイチェ・ロシア東欧株式ファンド」

< 評価額(全銘柄) >

(平成25年12月30日現在)

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量(口) | 簿価単価 評価単価 (円) | 簿価金額 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|------|---------------|-------------|----------------|---------------------|---------------------|-----------------|
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | 東欧株式マザーファンド | 10,633,514,962 | 0.9593 | 10,200,730,904 | 100.40 |
| | | | | 1.0004 | 10,637,768,367 | |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

< 種類別投資比率 >

(平成25年12月30日現在)

| 種類 | 国内/外国 | 投資比率(%) |
|-----------|-------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 国内 | 100.40 |
| 合計 | - | 100.40 |

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類別の評価金額の比率をいいます。

(参考情報)

「東欧株式マザーファンド」

< 評価額(上位30銘柄) >

(平成25年12月30日現在)

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 簿価単価 評価単価 (円) | 簿価金額 評価金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|-------|----|----------------------------------|---------------------|-----------|------------------------|--------------------------------|-----------------|
| ロシア | 株式 | SBERBANK-SPONSORED ADR | 銀行 | 850,000 | 1,220.26 1,305.78 | 1,037,223,876 1,109,914,785 | 8.74 |
| ロシア | 株式 | OAO GAZPROM SPON ADR | エネルギー | 900,000 | 831.52 896.86 | 748,374,390 807,182,010 | 6.36 |
| ロシア | 株式 | LUKOIL-SPON ADR | エネルギー | 115,000 | 6,316.02 6,519.42 | 726,342,610 749,733,921 | 5.90 |
| ロシア | 株式 | MAGNIT | 食品・生活 必需品小売 り | 23,000 | 25,579.20 29,560.56 | 588,321,758 679,893,042 | 5.35 |
| ロシア | 株式 | LSR GROUP OJSC-GDR REGS | 不動産 | 1,512,148 | 479.52 437.36 | 725,112,013 661,365,902 | 5.21 |
| ロシア | 株式 | SISTEMA JSFC | 電気通信 サービス | 3,750,000 | 96.95 145.61 | 363,595,500 546,065,111 | 4.30 |
| ポーランド | 株式 | PKO BANK POLSKI SA | 銀行 | 325,000 | 1,388.31 1,382.50 | 451,201,551 449,312,500 | 3.54 |
| ロシア | 株式 | NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S | エネルギー | 30,000 | 12,962.97 14,248.72 | 388,889,100 427,461,840 | 3.37 |
| ロシア | 株式 | SURGUTNEFTEGAS-PFD- CLS | エネルギー | 5,000,000 | 68.44 83.87 | 342,201,330 419,399,505 | 3.30 |
| キプロス | 株式 | TCS GROUP HOLDING - REG S W/I | 銀行 | 230,000 | 1,752.63 1,580.85 | 403,106,211 363,595,500 | 2.86 |
| ポーランド | 株式 | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 保険 | 20,500 | 16,271.50 15,872.50 | 333,565,750 325,386,250 | 2.56 |
| ロシア | 株式 | MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR | 素材 | 155,000 | 1,536.34 1,761.06 | 238,133,665 272,965,369 | 2.15 |
| トルコ | 株式 | AKBANK T.A.S. | 銀行 | 900,000 | 353.68 299.32 | 318,320,983 269,396,280 | 2.12 |
| ポルトガル | 株式 | JERONIMO MARTINS | 食品・生活 必需品小売 り | 125,000 | 2,235.94 2,062.61 | 279,493,218 257,826,375 | 2.03 |
| キプロス | 株式 | GLOBALTRA-SPONS GDR REG S | 運輸 | 150,000 | 1,506.02 1,663.05 | 225,903,465 249,458,130 | 1.96 |
| ロシア | 株式 | SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF | エネルギー | 300,000 | 679.76 826.25 | 203,929,650 247,877,280 | 1.95 |

| | | | | | | | |
|-------|----|-----------------------------|------------|-----------|------------------------|----------------------------|------|
| ロシア | 株式 | PIK GROUP | 耐久消費財・アパレル | 950,000 | 205.77 227.44 | 195,486,726 216,070,051 | 1.70 |
| チェコ | 株式 | KOMERCNI BANKA AS | 銀行 | 8,500 | 22,213.05 23,108.95 | 188,810,925 196,426,075 | 1.55 |
| トルコ | 株式 | TURKIYE GARANTI BANKASI | 銀行 | 600,000 | 366.82 316.93 | 220,095,000 190,162,080 | 1.50 |
| ロシア | 株式 | ROSTELECOM-PFD \$US | 電気通信サービス | 759,831 | 248.72 237.66 | 188,985,470 180,585,225 | 1.42 |
| ロシア | 株式 | BANK ST PETERSBURG | 銀行 | 1,336,111 | 149.53 134.58 | 199,796,241 179,817,866 | 1.42 |
| トルコ | 株式 | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 電気通信サービス | 325,000 | 584.47 550.23 | 189,954,212 178,827,187 | 1.41 |
| ポーランド | 株式 | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 素材 | 40,000 | 4,340.00 4,088.00 | 173,600,000 163,520,000 | 1.29 |
| ロシア | 株式 | RUSHYDRO-SP ADR REG S | 公益事業 | 828,669 | 162.30 181.90 | 134,493,475 150,737,492 | 1.19 |
| ポーランド | 株式 | BANK ZACHODNI WBK SA | 銀行 | 10,769 | 12,005.00 13,564.24 | 129,281,845 146,073,408 | 1.15 |
| ロシア | 株式 | TMK-GDR REG S | エネルギー | 120,000 | 1,213.80 1,211.98 | 145,656,357 145,438,200 | 1.15 |
| ロシア | 株式 | VTB BANK OJSC-GDR-REG S | 銀行 | 450,000 | 287.71 309.00 | 129,471,615 139,051,566 | 1.09 |
| チェコ | 株式 | CEZ AS | 公益事業 | 50,000 | 2,919.97 2,717.21 | 145,998,855 135,860,600 | 1.07 |
| ロシア | 株式 | SEVERSTAL-GDR REG S | 素材 | 130,000 | 974.21 1,022.28 | 126,648,556 132,896,790 | 1.05 |
| トルコ | 株式 | TURKIYE HALK BANKASI | 銀行 | 225,000 | 706.74 569.80 | 159,018,637 128,205,337 | 1.01 |

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率をいいます。

< 種類別及び業種別投資比率 >

(平成25年12月30日現在)

| 種類 | 国内 / 外国 | 業種 | 投資比率 (%) |
|------|---------|------------------------|----------|
| 株式 | 外国 | エネルギー | 24.36 |
| | | 素材 | 5.93 |
| | | 資本財 | 1.50 |
| | | 運輸 | 3.22 |
| | | 自動車・自動車部品 | 0.41 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 2.30 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 8.20 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 0.92 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 0.58 |
| | | 銀行 | 25.56 |
| | | 各種金融 | 1.92 |
| | | 保険 | 2.56 |
| | | 不動産 | 5.21 |
| | | ソフトウェア・サービス | 1.24 |
| | | 電気通信サービス | 7.75 |
| 公益事業 | 3.65 | | |
| | 小計 | 95.33 | |
| 社債券 | 外国 | 銀行 | 0.64 |
| | | 小計 | 0.64 |
| 投資証券 | 外国 | 不動産 | 0.47 |

| | | |
|--|----|-------|
| | 小計 | 0.47 |
| | 合計 | 96.44 |

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該種類別及び業種別の評価金額の比率をいいます。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

| 計算期間末 または各月末 | 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1期計算期間末(平成18年11月20日) | 8,876 | 10,164 | 1.0317 | 1.1814 |
| 第2期計算期間末(平成19年5月18日) | 16,234 | 20,201 | 1.0219 | 1.2716 |
| 第3期計算期間末(平成19年11月19日) | 81,663 | 91,318 | 1.0110 | 1.1305 |
| 第4期計算期間末(平成20年5月19日) | 95,883 | 95,883 | 0.9805 | 0.9805 |
| 第5期計算期間末(平成20年11月18日) | 18,438 | 18,438 | 0.2373 | 0.2373 |
| 第6期計算期間末(平成21年5月18日) | 23,073 | 23,073 | 0.3021 | 0.3021 |
| 第7期計算期間末(平成21年11月18日) | 32,921 | 32,921 | 0.4474 | 0.4474 |
| 第8期計算期間末(平成22年5月18日) | 30,583 | 30,583 | 0.4471 | 0.4471 |
| 第9期計算期間末(平成22年11月18日) | 24,965 | 24,965 | 0.4619 | 0.4619 |
| 第10期計算期間末(平成23年5月18日) | 21,580 | 21,580 | 0.4871 | 0.4871 |
| 第11期計算期間末(平成23年11月18日) | 14,080 | 14,080 | 0.3634 | 0.3634 |
| 第12期計算期間末(平成24年5月18日) | 13,058 | 13,058 | 0.3375 | 0.3375 |
| 第13期計算期間末(平成24年11月19日) | 11,822 | 11,822 | 0.3982 | 0.3982 |
| 第14期計算期間末(平成25年5月20日) | 18,323 | 18,323 | 0.5428 | 0.5428 |
| 第15期計算期間末(平成25年11月18日) | 10,986 | 10,986 | 0.5312 | 0.5312 |
| 平成24年12月末 | 13,442 | - | 0.4702 | - |
| 平成25年1月末 | 14,754 | - | 0.5160 | - |
| 平成25年2月末 | 18,530 | - | 0.5045 | - |
| 平成25年3月末 | 17,773 | - | 0.4975 | - |
| 平成25年4月末 | 17,820 | - | 0.5058 | - |
| 平成25年5月末 | 16,716 | - | 0.5138 | - |
| 平成25年6月末 | 14,788 | - | 0.4647 | - |
| 平成25年7月末 | 14,752 | - | 0.4815 | - |
| 平成25年8月末 | 11,284 | - | 0.4664 | - |
| 平成25年9月末 | 11,701 | - | 0.5095 | - |
| 平成25年10月末 | 11,434 | - | 0.5388 | - |
| 平成25年11月末 | 10,908 | - | 0.5408 | - |
| 平成25年12月末 | 10,594 | - | 0.5532 | - |

(注) 純資産総額は、百万円未満切捨て。

【分配の推移】

| | 1口当たりの分配金(円) |
|-----------------------------------|--------------|
| 第 1期計算期間(平成18年 5月26日～平成18年11月20日) | 0.1500 |
| 第 2期計算期間(平成18年11月21日～平成19年 5月18日) | 0.2500 |
| 第 3期計算期間(平成19年 5月19日～平成19年11月19日) | 0.1200 |
| 第 4期計算期間(平成19年11月20日～平成20年 5月19日) | 0.0000 |
| 第 5期計算期間(平成20年 5月20日～平成20年11月18日) | 0.0000 |
| 第 6期計算期間(平成20年11月19日～平成21年 5月18日) | 0.0000 |
| 第 7期計算期間(平成21年 5月19日～平成21年11月18日) | 0.0000 |
| 第 8期計算期間(平成21年11月19日～平成22年 5月18日) | 0.0000 |
| 第 9期計算期間(平成22年 5月19日～平成22年11月18日) | 0.0000 |
| 第10期計算期間(平成22年11月19日～平成23年 5月18日) | 0.0000 |
| 第11期計算期間(平成23年 5月19日～平成23年11月18日) | 0.0000 |
| 第12期計算期間(平成23年11月19日～平成24年 5月18日) | 0.0000 |
| 第13期計算期間(平成24年 5月19日～平成24年11月19日) | 0.0000 |
| 第14期計算期間(平成24年11月20日～平成25年 5月20日) | 0.0000 |
| 第15期計算期間(平成25年 5月21日～平成25年11月18日) | 0.0000 |

【収益率の推移】

| | 収益率(%) |
|-----------------------------------|--------|
| 第 1期計算期間(平成18年 5月26日～平成18年11月20日) | 18.1 |
| 第 2期計算期間(平成18年11月21日～平成19年 5月18日) | 23.3 |
| 第 3期計算期間(平成19年 5月19日～平成19年11月19日) | 10.6 |
| 第 4期計算期間(平成19年11月20日～平成20年 5月19日) | 3.0 |
| 第 5期計算期間(平成20年 5月20日～平成20年11月18日) | 75.8 |
| 第 6期計算期間(平成20年11月19日～平成21年 5月18日) | 27.3 |
| 第 7期計算期間(平成21年 5月19日～平成21年11月18日) | 48.1 |
| 第 8期計算期間(平成21年11月19日～平成22年 5月18日) | 0.1 |
| 第 9期計算期間(平成22年 5月19日～平成22年11月18日) | 3.3 |
| 第10期計算期間(平成22年11月19日～平成23年 5月18日) | 5.5 |
| 第11期計算期間(平成23年 5月19日～平成23年11月18日) | 25.4 |
| 第12期計算期間(平成23年11月19日～平成24年 5月18日) | 7.1 |
| 第13期計算期間(平成24年 5月19日～平成24年11月19日) | 18.0 |
| 第14期計算期間(平成24年11月20日～平成25年 5月20日) | 36.3 |
| 第15期計算期間(平成25年 5月21日～平成25年11月18日) | 2.1 |

(注) 収益率は、小数第 2 位を四捨五入しております。

(参考情報)

基準日：2013年12月30日

基準価額・純資産の推移



※1 基準価額の推移は、信託報酬控除後の価額を表示しております。

※2 分配金込基準価額の推移は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

分配の推移

| 1万口当たり、税引前 | |
|------------|--------|
| 2013年11月 | 0円 |
| 2013年5月 | 0円 |
| 2012年11月 | 0円 |
| 2012年5月 | 0円 |
| 2011年11月 | 0円 |
| 設定来累計 | 5,200円 |

主要な資産の状況

マザーファンドにおける組入上位10銘柄

| | 銘柄 | 国 | 業種 | 比率(%) |
|----|-----------------|-------|----------|-------|
| 1 | ズベルバンク(ADR) | ロシア | 金融 | 8.7 |
| 2 | ガズプロム(ADR) | ロシア | エネルギー | 6.4 |
| 3 | ルクオイル(ADR) | ロシア | エネルギー | 5.9 |
| 4 | マグニト | ロシア | 生活必需品 | 5.4 |
| 5 | LSRグループ | ロシア | 金融 | 5.2 |
| 6 | JSFC システム | ロシア | 電気通信サービス | 4.3 |
| 7 | PKO バンク・ポルスキ | ポーランド | 金融 | 3.5 |
| 8 | ノバテック(GDR) | ロシア | エネルギー | 3.4 |
| 9 | スルグトネフガス | ロシア | エネルギー | 3.3 |
| 10 | TCS グループホールディング | キプロス | 金融 | 2.9 |

マザーファンドにおける
国別構成比

| 国 | 比率(%) |
|-------|-------|
| ロシア | 61.2 |
| トルコ | 10.9 |
| ポーランド | 10.2 |
| チェコ | 2.6 |
| ハンガリー | 1.2 |
| その他 | 10.3 |

※ 比率はマザーファンドにおける組入比率です。

年間収益率の推移



※1 年間収益率の推移は、分配金(税引前)を再投資したものと計算しております。

※2 2006年は設定日(5月26日)から年末までの騰落率を表示しております。

※3 当ファンドにベンチマークはありません。

(注1) 上記は過去の実績であり、将来の運用成果等を保証もしくは示唆するものではありません。

(注2) 最新の運用実績は、委託会社のホームページで開示されております。

(4)【設定及び解約の実績】

下記期間中の設定及び解約の実績は次の通りです。

| | 設定数量(口) | 解約数量(口) |
|----------------------------------|----------------|----------------|
| 第1期計算期間(平成18年5月26日～平成18年11月20日) | 9,974,741,287 | 1,370,970,144 |
| 第2期計算期間(平成18年11月21日～平成19年5月18日) | 15,062,023,499 | 7,779,065,582 |
| 第3期計算期間(平成19年5月19日～平成19年11月19日) | 82,219,349,722 | 17,330,662,462 |
| 第4期計算期間(平成19年11月20日～平成20年5月19日) | 40,335,438,070 | 23,325,736,320 |
| 第5期計算期間(平成20年5月20日～平成20年11月18日) | 10,707,707,826 | 30,802,091,769 |
| 第6期計算期間(平成20年11月19日～平成21年5月18日) | 8,339,553,955 | 9,662,685,772 |
| 第7期計算期間(平成21年5月19日～平成21年11月18日) | 21,723,723,865 | 24,500,203,544 |
| 第8期計算期間(平成21年11月19日～平成22年5月18日) | 21,502,799,422 | 26,688,446,605 |
| 第9期計算期間(平成22年5月19日～平成22年11月18日) | 8,627,084,036 | 22,984,426,790 |
| 第10期計算期間(平成22年11月19日～平成23年5月18日) | 6,895,973,288 | 16,642,851,218 |
| 第11期計算期間(平成23年5月19日～平成23年11月18日) | 2,094,780,200 | 7,653,106,787 |
| 第12期計算期間(平成23年11月19日～平成24年5月18日) | 10,254,519,341 | 10,309,708,294 |
| 第13期計算期間(平成24年5月19日～平成24年11月19日) | 1,196,693,173 | 10,197,306,493 |
| 第14期計算期間(平成24年11月20日～平成25年5月20日) | 13,317,937,185 | 9,249,962,986 |
| 第15期計算期間(平成25年5月21日～平成25年11月18日) | 407,230,667 | 13,479,836,765 |

(注) 設定数量には、当初設定数量を含みます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

<訂正前>

（前略）

申込単位は、販売会社が定める単位とします。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。申込単位の詳細については、販売会社または委託会社の後記照会先にお問合せ下さい。

（中略）

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.675%（税抜3.5%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料の詳細については、販売会社または委託会社の後記照会先にお問合せ下さい。

収益分配金を再投資する場合の申込手数料は無手数料とします。

（以下略）

<訂正後>

（前略）

申込単位は、販売会社が定める単位とします。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。申込単位の詳細については、販売会社にお問合せ下さい。

（中略）

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に3.675%^{*}（税抜3.5%）を上限として販売会社が定める手数料率を乗じて得た額とします。申込手数料の詳細については、販売会社にお問合せ下さい。

収益分配金を再投資する場合の申込手数料は無手数料とします。

* 消費税率が8%になった場合は、3.78%となります。

（以下略）

2【換金（解約）手続等】

<訂正前>

（前略）

解約単位は、販売会社が定める単位とします。解約単位の詳細については、販売会社または委託会社の後記照会先にお問合せ下さい。

（以下略）

<訂正後>

（前略）

解約単位は、販売会社が定める単位とします。解約単位の詳細については、販売会社にお問合せ下さい。

（以下略）

第3【ファンドの経理状況】

本項を以下の記載内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドの計算期間は6ヶ月であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
3. 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15期計算期間（平成25年5月21日から平成25年11月18日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

ドイチェ・ロシア東欧株式ファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第14期計算期間 (平成25年5月20日現在) | 第15期計算期間 (平成25年11月18日現在) |
|-----------------|----------------------------|-----------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 24,709,908 | 116,346 |
| 親投資信託受益証券 | 19,167,581,084 | 11,243,861,301 |
| 未収利息 | 20 | - |
| 流動資産合計 | 19,192,291,012 | 11,243,977,647 |
| 資産合計 | 19,192,291,012 | 11,243,977,647 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 706,988,448 | 124,092,132 |
| 未払受託者報酬 | 6,769,736 | 5,615,849 |
| 未払委託者報酬 | 152,319,038 | 126,356,532 |
| その他未払費用 | 2,610,025 | 1,867,273 |
| 流動負債合計 | 868,687,247 | 257,931,786 |
| 負債合計 | 868,687,247 | 257,931,786 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 33,755,100,103 | 20,682,494,005 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 15,431,496,338 | 9,696,448,144 |
| (分配準備積立金) | 638,058,197 | 530,076,091 |
| 元本等合計 | 18,323,603,765 | 10,986,045,861 |
| 純資産合計 | 18,323,603,765 | 10,986,045,861 |
| 負債純資産合計 | 19,192,291,012 | 11,243,977,647 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第14期計算期間 (自 平成24年11月20日 至 平成25年 5月20日) | 第15期計算期間 (自 平成25年 5月21日 至 平成25年11月18日) |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 5,614 | 166 |
| 有価証券売買等損益 | 4,392,982,728 | 740,510,740 |
| 営業収益合計 | 4,392,988,342 | 740,510,574 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 6,769,736 | 5,615,849 |
| 委託者報酬 | 152,319,038 | 126,356,532 |
| その他費用 | 2,610,025 | 1,867,273 |
| 営業費用合計 | 161,698,799 | 133,839,654 |
| 営業利益又は営業損失() | 4,231,289,543 | 874,350,228 |
| 経常利益又は経常損失() | 4,231,289,543 | 874,350,228 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 4,231,289,543 | 874,350,228 |
| 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() | 725,156,681 | 623,331,889 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 17,864,458,593 | 15,431,496,338 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 5,365,676,340 | 6,182,036,503 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 5,365,676,340 | 6,182,036,503 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 6,438,846,947 | 195,969,970 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 6,438,846,947 | 195,969,970 |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 15,431,496,338 | 9,696,448,144 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|-----------------|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。 |
|-----------------|---|

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第14期計算期間 (平成25年5月20日現在) | 第15期計算期間 (平成25年11月18日現在) |
|-------------------------------------|----------------------------|-----------------------------|
| 1. 受益権の総数 | 33,755,100,103口 | 20,682,494,005口 |
| 2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 | 15,431,496,338円 | 9,696,448,144円 |
| 3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.5428円 (5,428円) | 0.5312円 (5,312円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第14期計算期間 (自 平成24年11月20日 至 平成25年 5月20日) | 第15期計算期間 (自 平成25年 5月21日 至 平成25年11月18日) |
|---|--|--|
| 1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額 | 純資産総額に対して年率0.3%以内の額 | 同左 |
| 2. 分配金の計算方法 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(172,696,142円)、収益調整金(1,006,480,902円)、分配準備積立金(465,362,055円)より、分配対象収益は、1,644,539,099円(1万口当たり487円)であります。今期は分配を行っておりません。 | 計算期間末における費用控除後の配当等収益(128,102,273円)、収益調整金(622,764,835円)、分配準備積立金(401,973,818円)より、分配対象収益は、1,152,840,926円(1万口当たり557円)であります。今期は分配を行っておりません。 |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 第14期計算期間 (自 平成24年11月20日 至 平成25年 5月20日) | 第15期計算期間 (自 平成25年 5月21日 至 平成25年11月18日) |
|--------------------------|--|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。 | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | 当ファンド及び主要投資対象である親投資信託が保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細は貸借対照表、注記表及び附属明細表に記載しております。当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等)、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |

| | | |
|-------------------|--|----|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社では2つの検証機能を有しています。1つは運用評価会議で、ここではパフォーマンス分析及び定量的リスク分析が行われます。もう1つはインベストメント・コントロール・コミティーで、ここでは運用部、業務部、コンプライアンス統括部から市場リスク、流動性リスク、信用リスク、運用ガイドライン・法令等遵守状況など様々なリスク管理状況が報告され、検証が行われます。このコミティーで議論された内容は、取締役会から一部権限を委譲されたエグゼクティブ・コミティーに報告され、委託会社として必要な対策を指示する体制がとられています。運用部ではこうしたリスク管理の結果も考慮し、次の投資戦略を決定し、日々の運用業務を行っております。 | 同左 |
|-------------------|--|----|

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第14期計算期間 (平成25年5月20日現在) | 第15期計算期間 (平成25年11月18日現在) |
|----------------------------|--|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)売買目的有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 | (1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)売買目的有価証券 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

計算期間の損益に含まれた評価差額(円)

| 種類 | 第14期計算期間 (平成25年5月20日現在) | 第15期計算期間 (平成25年11月18日現在) |
|-----------|----------------------------|-----------------------------|
| 親投資信託受益証券 | 4,103,820,680 | 154,715,907 |
| 合計 | 4,103,820,680 | 154,715,907 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

| 項目 | 第14期計算期間 (平成25年5月20日現在) 金額(円) | 第15期計算期間 (平成25年11月18日現在) 金額(円) |
|-----------|-------------------------------------|--------------------------------------|
| 元本の推移 | | |
| 期首元本額 | 29,687,125,904 | 33,755,100,103 |
| 期中追加設定元本額 | 13,317,937,185 | 407,230,667 |
| 期中一部解約元本額 | 9,249,962,986 | 13,479,836,765 |

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(ア)株式

該当事項はありません。

(イ)株式以外の有価証券

| 種類 | 銘柄 | 口数 | 評価額(円) | 備考 |
|-----------|-------------|----------------|----------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 東欧株式マザーファンド | 11,720,902,013 | 11,243,861,301 | |
| 合計 | | 11,720,902,013 | 11,243,861,301 | |

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

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。

（参考情報）

当ファンドは「東欧株式マザーファンド」の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、当ファンドの計算期間末日における同親投資信託の状況は次の通りです。

「東欧株式マザーファンド」の状況

以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

(1)貸借対照表

| 区分 | (平成25年5月20日現在) | (平成25年11月18日現在) |
|-------------|----------------|-----------------|
| | 金額(円) | 金額(円) |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 77,238,020 | 231,345,535 |
| コール・ローン | 193,287,990 | 115,423,282 |
| 株式 | 19,766,651,969 | 12,589,441,652 |
| オプション証券等 | 342,164,844 | 71,446,355 |
| 社債券 | 230,379,656 | 83,545,180 |
| 投資証券 | 154,704,683 | 80,028,000 |
| 未収入金 | 771,710,774 | 292,440,766 |
| 未収配当金 | 105,385,056 | 29,302,864 |
| 未収利息 | 158 | 94 |
| 流動資産合計 | 21,641,523,150 | 13,492,973,728 |
| 資産合計 | 21,641,523,150 | 13,492,973,728 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 8,745,412 | 1,861,071 |
| 未払金 | - | 132,837,746 |
| 流動負債合計 | 8,745,412 | 134,698,817 |
| 負債合計 | 8,745,412 | 134,698,817 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 22,235,881,900 | 13,925,020,112 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 603,104,162 | 566,745,201 |
| 元本等合計 | 21,632,777,738 | 13,358,274,911 |
| 純資産合計 | 21,632,777,738 | 13,358,274,911 |
| 負債純資産合計 | 21,641,523,150 | 13,492,973,728 |

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| | |
|----------------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式、オプション証券等、社債券、投資証券につきましては移動平均法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1)金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として、金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場(外貨建証券等の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場)で評価しております。 計算期間の末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該金融商品取引所等における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>(2)金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、日本証券業協会の公社債店頭売買参考統計値、金融機関の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3)時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、投資信託委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託会社と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>為替予約の評価は、個別法に基づき、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物相場の仲値によって計算しております。ただし、為替予約のうち対顧客先物相場が発表されていない通貨については、対顧客相場の仲値によって計算しております。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第61条に基づいております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (平成25年5月20日現在) | (平成25年11月18日現在) |
|-------------------------------------|---------------------|---------------------|
| 1. 受益権の総数 | 22,235,881,900口 | 13,925,020,112口 |
| 2. 元本の欠損 純資産額が元本総額を下回る場合におけるその差額 | 603,104,162円 | 566,745,201円 |
| 3. 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 0.9729円 (9,729円) | 0.9593円 (9,593円) |

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

| 項目 | (自 平成24年11月20日 至 平成25年 5月20日) | (自 平成25年 5月21日 至 平成25年11月18日) |
|--------------------------|--|----------------------------------|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | <p>当親投資信託は証券投資信託として、有価証券、デリバティブ取引等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。</p> | 同左 |
| 2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク | <p>当親投資信託が保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細は貸借対照表、注記表及び附属明細表に記載しております。当該金融商品には、性質に応じてそれぞれ市場リスク(価格変動リスク、為替変動リスク、金利変動リスク等)、流動性リスク、信用リスク等があります。</p> <p>当親投資信託が行うデリバティブ取引については、外貨建金銭債権債務等の為替変動リスクを回避し、安定的な利益の確保を図る目的で利用しております。</p> | 同左 |

| | | |
|-------------------|---|----|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | 委託会社では2つの検証機能を有しています。1つは運用評価会議で、ここではパフォーマンス分析及び定量的リスク分析が行われます。もう1つはインベストメント・コントロール・コミッティーで、ここでは運用部、業務部、コンプライアンス統括部から市場リスク、流動性リスク、信用リスク、委託先リスク、運用ガイドライン・法令等遵守状況など様々なリスク管理状況が報告され、検証が行われます。このコミッティーで議論された内容は、取締役会から一部権限を委譲されたエグゼクティブ・コミッティーに報告され、委託会社として必要な対策を指示する体制がとられています。運用部ではこうしたリスク管理の結果も考慮し、次の投資戦略を決定し、日々の運用委託先管理業務を行っております。 | 同左 |
|-------------------|---|----|

金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成25年5月20日現在) | (平成25年11月18日現在) |
|----------------------------|---|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額 | 貸借対照表計上額は期末の時価で計上しているため、その差額はありません。 | 同左 |
| 2. 時価の算定方法 | (1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 (2)売買目的有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (3)デリバティブ取引 (デリバティブ取引に関する注記)に記載しております。 | (1)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左 (2)売買目的有価証券 同左 (3)デリバティブ取引 同左 |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、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であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

計算期間の損益に含まれた評価差額(円)

| 種類 | (平成25年5月20日現在) | (平成25年11月18日現在) |
|----------|----------------|-----------------|
| 株式 | 673,120,410 | 598,972,287 |
| オプション証券等 | 23,762,844 | 1,282,794 |
| 社債券 | 39,214,346 | 4,075,383 |
| 投資証券 | 10,427,597 | 5,928,000 |
| 合計 | 746,525,197 | 607,692,876 |

(注)「計算期間」とは当親投資信託の計算期間の期首日から本書における開示対象ファンドの計算期間末日までの期間を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(通貨関連)

| 区分 | 種類 | (平成25年5月20日現在) | | | |
|-----------|------------------------|----------------|----------|-------------|-----------|
| | | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
| | | | うち1年超(円) | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 アメリカドル | 836,119,957 | - | 844,865,369 | 8,745,412 |
| | 合計 | 836,119,957 | - | 844,865,369 | 8,745,412 |

| 区分 | 種類 | (平成25年11月18日現在) | | | |
|-----------|------------------------|-----------------|----------|-------------|-----------|
| | | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
| | | | うち1年超(円) | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 アメリカドル | 299,802,822 | - | 301,663,893 | 1,861,071 |
| | 合計 | 299,802,822 | - | 301,663,893 | 1,861,071 |

(注1)時価の算定方法

1. 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

為替予約の受渡日(以下「当該日」という。)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後2つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2. 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客相場の仲値で評価しております。

(注2)デリバティブ取引にヘッジ会計は適用されておられません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

| 項目 | (平成25年5月20日現在) | (平成25年11月18日現在) |
|--------------------|----------------|-----------------|
| | 金額(円) | 金額(円) |
| 1. 元本の推移 | | |
| 期首元本額 | 20,019,253,713 | 22,235,881,900 |
| 期中追加設定元本額 | 5,244,587,344 | 81,972,620 |
| 期中一部解約元本額 | 3,027,959,157 | 8,392,834,408 |
| 期末元本額 | 22,235,881,900 | 13,925,020,112 |
| 2. 元本の内訳 | | |
| りそな 東欧フロンティア株式ファンド | 2,534,390,396 | 2,204,118,099 |
| ドイチェ・ロシア東欧株式ファンド | 19,701,491,504 | 11,720,902,013 |

(3)附属明細表

有価証券明細表

(ア)株式

| 通貨 | 銘柄 | 数量 | 評価額 | | 備考 |
|--------|------------------------------|-----------|----------|--------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| アメリカドル | EURASIA DRILLIN-GDR REGS | 12,600 | 43.25 | 544,950.00 | |
| | LUKOIL-SPON ADR | 130,000 | 63.77 | 8,290,100.00 | |
| | NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S | 35,000 | 136.00 | 4,760,000.00 | |
| | OAO GAZPROM SPON ADR | 1,050,000 | 9.04 | 9,497,250.00 | |
| | SOCIETATEA NATIONAL-GDR REGS | 39,115 | 10.30 | 402,884.50 | |
| | SURGUTNEFTEGAS-PFD-CLS | 5,000,000 | 0.73 | 3,654,500.00 | |
| | SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR PREF | 300,000 | 7.26 | 2,178,000.00 | |
| | TATNEFT-SPONSORED ADR | 35,000 | 38.41 | 1,344,350.00 | |
| | TRANSNEFT-PFD-CLS | 450 | 2,529.38 | 1,138,221.58 | |
| | MMC NORILSK NICKEL JSC-ADR | 155,000 | 14.74 | 2,284,700.00 | |
| | MOSTOTREST-CLS | 294,524 | 4.41 | 1,301,707.72 | |
| | GLOBALTRA-SPONS GDR REG S | 150,000 | 15.10 | 2,265,000.00 | |
| | MAGNIT | 29,000 | 267.79 | 7,765,918.70 | |
| | BANK ST PETERSBURG | 1,336,111 | 1.40 | 1,873,227.62 | |
| | SBERBANK-SPONSORED ADR | 700,000 | 12.66 | 8,862,000.00 | |

| | | | | | |
|------------|------------------------------|------------|----------|------------------|--|
| | TCS GROUP HOLDING -REG S W/I | 240,000 | 11.50 | 2,760,000.00 | |
| | VTB BANK OJSC-GDR-REG S | 450,000 | 2.77 | 1,246,950.00 | |
| | MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS | 1,100,000 | 1.99 | 2,191,310.00 | |
| | LSR GROUP OJSC-GDR REGS | 1,512,148 | 3.70 | 5,596,459.74 | |
| | LUXOFT HOLDING INC | 72,161 | 33.80 | 2,439,041.80 | |
| | YANDEX NV-A | 53,221 | 38.52 | 2,050,072.92 | |
| | MOBILE TELESYSTEMS-\$ | 100,000 | 10.01 | 1,001,650.00 | |
| | ROSTELECOM-PFD \$US | 759,831 | 2.40 | 1,830,736.81 | |
| | SISTEMA JSFC | 5,900,000 | 1.18 | 7,016,870.00 | |
| | E.ON RUSSIA JSC | 15,000,000 | 0.07 | 1,108,500.00 | |
| | RUSHYDRO-SP ADR REG S | 859,231 | 1.65 | 1,421,168.07 | |
| 小計 | | | | 84,825,569.46 | |
| ユーロ | JERONIMO MARTINS | 125,000 | 14.70 | 1,838,125.00 | |
| | ERSTE GROUP BANK AG | 20,000 | 25.43 | 508,600.00 | |
| 小計 | | | | 2,346,725.00 | |
| イギリスポンド | EVRAZ PLC | 392,610 | 1.16 | 457,390.65 | |
| 小計 | | | | 457,390.65 | |
| トルコリラ | KOZA ANADOLU METAL MADENCILI | 625,000 | 4.15 | 2,593,750.00 | |
| | ENKA INSAAT VE SANAYI AS | 445,000 | 6.54 | 2,910,300.00 | |
| | TRAKYA CAM SANAYII AS | 600,000 | 2.42 | 1,452,000.00 | |
| | TURK HAVA YOLLARI AO | 200,000 | 7.48 | 1,496,000.00 | |
| | TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA | 125,000 | 12.90 | 1,612,500.00 | |
| | BIZIM TOPTAN SATIS MAGAZALAR | 38,506 | 22.35 | 860,609.10 | |
| | COCA-COLA ICECEK AS | 35,000 | 52.50 | 1,837,500.00 | |
| | ULKER BISKUVI SANA-REGS/144A | 85,000 | 17.35 | 1,474,750.00 | |
| | AKBANK T.A.S. | 900,000 | 7.28 | 6,552,000.00 | |
| | TURKIYE GARANTI BANKASI | 850,000 | 7.64 | 6,494,000.00 | |
| | TURKIYE HALK BANKASI | 325,000 | 15.35 | 4,988,750.00 | |
| | HACI OMER SABANCI HOLDING | 300,000 | 9.04 | 2,712,000.00 | |
| | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | 425,000 | 12.20 | 5,185,000.00 | |
| 小計 | | | | 40,169,159.10 | |
| チェココルナ | KOMERCNI BANKA AS | 8,500 | 4,580.00 | 38,930,000.00 | |
| | CEZ AS | 50,000 | 550.40 | 27,520,000.00 | |
| 小計 | | | | 66,450,000.00 | |
| ハンガリーフォロント | RICHTER GEDEON NYRT | 35,000 | 4,450.00 | 155,750,000.00 | |
| 小計 | | | | 155,750,000.00 | |
| ポーランドズロチ | KGHM POLSKA MIEDZ SA | 64,000 | 119.50 | 7,648,000.00 | |
| | INTEGER.PL SA | 5,248 | 312.50 | 1,640,000.00 | |
| | PKP CARGO SA | 25,861 | 83.01 | 2,146,721.61 | |
| | LPP SA | 250 | 9,045.00 | 2,261,250.00 | |
| | BANK ZACHODNI WBK SA | 10,769 | 378.00 | 4,070,682.00 | |
| | PKO BANK POLSKI SA | 325,000 | 41.29 | 13,419,250.00 | |
| | POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | 20,500 | 453.65 | 9,299,825.00 | |
| 小計 | | | | 40,485,728.61 | |
| 合計 | | | | 12,589,441,652 | |
| | | | | (12,589,441,652) | |

(イ)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 数量 | 評価額 | 備考 |
|----------|-------|----------------------------|------------|--------------|----|
| オプション証券等 | トルコリラ | MERRILL-CW14 YAPI VE KREDI | 325,000.00 | 1,446,282.50 | |
| | 計 | | | 1,446,282.50 | |
| | 小計 | | | (71,446,355) | |
| | | | | 1,446,282.50 | |
| | | | | (71,446,355) | |

| | | | | | |
|------|---------|--|-----------|--|--|
| 社債券 | アメリカドル計 | MORGAN STANLEY BV OTP BANK 03/04/2014 | 40,000.00 | 833,036.00 833,036.00 (83,545,180) | |
| | 小計 | | | 833,036.00 (83,545,180) | |
| 投資証券 | トルコリラ計 | EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YA | 600,000 | 1,620,000.00 1,620,000.00 (80,028,000) | |
| | 小計 | | | 1,620,000.00 (80,028,000) | |
| 合計 | | | | 235,019,535 (235,019,535) | |

(注)1.通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

2.小計・合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

3.外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入株式 時価比率 | 組入オプション 証券等時価比率 | 組入債券 時価比率 | 組入投資証券 時価比率 | 合計金額に 対する比率 |
|----------------|-------------|--------------|--------------------|--------------|----------------|----------------|
| アメリカドル | 株式 | 26銘柄 | 63.7% | - | - | 67.0% |
| | 社債券 | 1銘柄 | - | - | 0.6% | |
| ユーロ | 株式 | 2銘柄 | 2.4% | - | - | 2.5% |
| イギリスポンド | 株式 | 1銘柄 | 0.6% | - | - | 0.6% |
| トルコリラ | 株式 | 13銘柄 | 14.9% | - | - | 16.6% |
| | オプション | 1銘柄 | - | 0.5% | - | |
| | 証券等 投資証券 | 1銘柄 | - | - | 0.6% | |
| チェココルナ | 株式 | 2銘柄 | 2.5% | - | - | 2.6% |
| ハンガリー フォリント | 株式 | 1銘柄 | 0.5% | - | - | 0.5% |
| ポーランドズ ロチ | 株式 | 7銘柄 | 9.8% | - | - | 10.2% |

信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

(2)注記表(デリバティブ取引に関する注記) 取引の時価等に関する事項に記載しております。

2【ファンドの現況】**【純資産額計算書】**

「ドイチェ・ロシア東欧株式ファンド」

(平成25年12月30日現在)

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 10,637,768,367円 |
| 負債総額 | 42,860,412円 |
| 純資産総額(-) | 10,594,907,955円 |
| 発行済数量 | 19,151,833,322口 |
| 1単位当たり純資産額(/) | 0.5532円 |

(参考情報)

「東欧株式マザーファンド」

(平成25年12月30日現在)

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 12,985,756,666円 |
| 負債総額 | 285,393,491円 |
| 純資産総額(-) | 12,700,363,175円 |
| 発行済数量 | 12,695,293,670口 |
| 1単位当たり純資産額(/) | 1.0004円 |

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<訂正前>

(1) 資本金等

資本金の額

3,078百万円（平成25年6月末現在）

発行する株式の総数

200,000株（平成25年6月末現在）

発行済株式総数

61,560株（平成25年6月末現在）

（以下略）

<訂正後>

(1) 資本金等

資本金の額

3,078百万円（平成25年12月末現在）

発行する株式の総数

200,000株（平成25年12月末現在）

発行済株式総数

61,560株（平成25年12月末現在）

（以下略）

2【事業の内容及び営業の概況】

本項を以下の記載内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

投信法に定める投資信託委託会社である委託会社は、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投資助言業務を行っています。

平成25年12月末現在、委託会社の運用するファンドは104本、純資産総額は749,456百万円です（ただし、親投資信託を除きます。）。ファンドの種類別の本数及び純資産総額は下記の通りです。

| 種類 | | | 本数 | 純資産総額 |
|----|-----|--------|------|------------|
| 公募 | 単位型 | 株式投資信託 | 1本 | 12,912百万円 |
| | 追加型 | 株式投資信託 | 83本 | 682,703百万円 |
| 私募 | 追加型 | 株式投資信託 | 20本 | 53,841百万円 |
| 合計 | | | 104本 | 749,456百万円 |

3【委託会社等の経理状況】

本項の末尾に以下の内容を追加します。

< 追加 >

1. 中間財務諸表の作成方法について

当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)第38条及び第57条の規定に基づき、同規則及び「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。

中間財務諸表に記載している金額については、千円未満の端数を切り捨てにより記載しております。

2. 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間(平成25年4月1日から平成25年9月30日まで)の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による中間監査を受けております。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

| | | 当中間会計期間末 (平成25年9月30日) |
|--------------|---|--------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | | 6,582,629 |
| 前払費用 | | 15,294 |
| 未収委託者報酬 | | 798,905 |
| 未収運用受託報酬 | | 16,374 |
| 未収投資助言報酬 | | 11,555 |
| 未収収益 | | 1,121,050 |
| 立替金 | | 31,486 |
| 繰延税金資産 | | 619,055 |
| 為替予約 | | 13,574 |
| 流動資産計 | | 9,209,927 |
| 固定資産 | | |
| 無形固定資産 | 1 | 1,954 |
| 投資その他の資産 | | |
| 繰延税金資産 | | 92,814 |
| その他 | | 28,067 |
| 固定資産計 | | 122,835 |
| 資産合計 | | 9,332,763 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | | 71,138 |
| 未払金 | | |
| 未払手数料 | | 403,314 |
| その他未払金 | | 51,527 |
| 未払費用 | | 1,112,548 |
| 未払法人税等 | | 707,521 |
| 未払消費税等 | 2 | 34,795 |
| 賞与引当金 | | 239,439 |
| 事務所退去損失引当金 | | 83,360 |
| 為替予約 | | 94 |
| 流動負債計 | | 2,703,740 |
| 固定負債 | | |
| 長期未払費用 | | 266,926 |
| 退職給付引当金 | | 579,379 |
| 賞与引当金 | | 136,459 |
| 固定負債計 | | 982,765 |
| 負債合計 | | 3,686,506 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | 3,078,000 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | | 1,830,000 |
| 資本剰余金計 | | 1,830,000 |
| 利益剰余金 | | |
| その他利益剰余金 | | |
| 繰越利益剰余金 | | 738,202 |
| 利益剰余金計 | | 738,202 |

| | |
|--------------|-----------|
| 株主資本計 | 5,646,202 |
| 評価・換算差額等 | |
| その他有価証券評価差額金 | 54 |
| 評価・換算差額等合計 | 54 |
| 純資産合計 | 5,646,256 |
| 負債・純資産合計 | 9,332,763 |

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

| 当中間会計期間 | |
|---------------|-------------|
| (自 平成25年4月1日 | |
| 至 平成25年9月30日) | |
| 営業収益 | |
| 委託者報酬 | 4,058,468 |
| 運用受託報酬 | 42,513 |
| 投資助言報酬 | 21,399 |
| その他営業収益 | 1,680,660 |
| 営業収益計 | 5,803,043 |
| 営業費用 | |
| 支払手数料 | 2,105,042 |
| その他営業費用 | 624,889 |
| 営業費用計 | 2,729,932 |
| 一般管理費 | 1 1,833,065 |
| 営業利益 | 1,240,044 |
| 営業外収益 | 2,611 |
| 営業外費用 | 2 29,209 |
| 経常利益 | 1,213,446 |
| 特別損失 | 3 59,337 |
| 税引前中間純利益 | 1,154,108 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 691,416 |
| 法人税等調整額 | 172,978 |
| 法人税等合計 | 518,438 |
| 中間純利益 | 635,670 |

重要な会計方針

| | 当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日) |
|----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>その他有価証券 時価のあるもの</p> <p>当中間会計期間末の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。</p> |
| 2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法 | 時価法を採用しております。 |
| 3. 固定資産の減価償却の方法 | <p>無形固定資産</p> <p>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、社内における見込利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。</p> |
| 4. 引当金の計上基準 | <p>(1) 貸倒引当金</p> <p>一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。但し、当中間会計期間末の計上額はありません。</p> <p>(2) 賞与引当金</p> <p>支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 事務所退去損失引当金</p> <p>不動産賃貸借契約に基づき使用する事務所等の一部退去に伴う資産除去費用に関連して負担する支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(4) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき、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。数理計算上の差異は、その発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(5年)による定額法により按分した額を翌期から費用処理することとしております。</p> |
| 5. 外貨建資産及び負債の本邦通貨への換算基準 | 外貨建の金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。 |
| 6. その他中間財務諸表のための基本となる重要な事項 | <p>消費税等の会計処理</p> <p>消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。</p> |

注記事項

(中間貸借対照表関係)

| | 当中間会計期間末 (平成25年9月30日) |
|--|--------------------------|
| 1 無形固定資産の減価償却累計額は次の通りであります。 | |
| ソフトウェア | 86,700千円 |
| 2 消費税等の取扱い | |
| 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺の上、流動負債の「未払消費税等」として表示しております。 | |

(中間損益計算書関係)

| | 当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日) |
|-----------|--|
| 1 減価償却実施額 | |
| 無形固定資産 | 5,103千円 |

| | |
|---------------|----------|
| 2 営業外費用の主要項目 | |
| 為替差損 | 10,755千円 |
| 事務処理損失 | 18,454千円 |
| 3 特別損失の主要項目 | |
| 事務所退去損失引当金繰入額 | 53,824千円 |
| 割増退職金 | 5,513千円 |

(リース取引関係)

| 当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日) | | | |
|--|-----------|-----------|-------------|
| リース取引開始日が平成20年3月31日以前の所有権移転外ファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。 | | | |
| ファイナンス・リース取引（借主側） | | | |
| リース取引に関する会計基準適用初年度開始前の所有権移転外ファイナンス・リース取引 | | | |
| 1. リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び中間会計期間末残高相当額 | | | |
| | 器具備品 | 建物附属設備 | 合計 |
| 取得価額相当額 | 393,859千円 | 653,585千円 | 1,047,445千円 |
| 減価償却累計額相当額 | 362,663千円 | 432,018千円 | 794,681千円 |
| 中間会計期間末残高相当額 | 31,196千円 | 221,567千円 | 252,764千円 |
| 2. 未経過リース料中間会計期間末残高相当額 | | | |
| 1年以内 | | 40,932千円 | |
| 1年超 | | 155,856千円 | |
| 合計 | | 196,788千円 | |
| 3. 支払リース料、減価償却費相当額、支払利息相当額 | | | |
| 支払リース料 | | 21,695千円 | |
| 減価償却費相当額 | | 18,618千円 | |
| 支払利息相当額 | | 1,365千円 | |
| 4. 減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法 | | | |
| (1) 減価償却費相当額の算定方法 | | | |
| リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。 | | | |
| (2) 利息相当額の算定方法 | | | |
| リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。 | | | |

(金融商品関係)

当中間会計期間末（平成25年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成25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、以下のとおりであります。

(単位:千円)

| | 中間貸借対照表 計上額 | 時価 | 差額 |
|-----------------------------------|----------------|-----------|----|
| (1)預金 | 6,582,629 | 6,582,629 | - |
| (2)未収委託者報酬 | 798,905 | 798,905 | - |
| (3)未収運用受託報酬 | 16,374 | 16,374 | - |
| (4)未収投資助言報酬 | 11,555 | 11,555 | - |
| (5)未収収益 | 1,121,050 | 1,121,050 | - |
| (6)投資有価証券 その他の有価証券 | 17,387 | 17,387 | - |
| 資産計 | 8,547,903 | 8,547,903 | - |
| (1)未払手数料 | 403,314 | 403,314 | - |
| (2)未払費用 | 1,112,548 | 1,112,548 | - |
| (3)未払法人税等 | 707,521 | 707,521 | - |
| (4)長期未払費用 | 266,926 | 266,926 | - |
| 負債計 | 2,490,312 | 2,490,312 | - |
| デリバティブ取引 (*1) ヘッジ会計が適用されていないもの | 13,480 | 13,480 | - |
| デリバティブ取引計 | 13,480 | 13,480 | - |

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

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

資 産

(1)預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬、(4)未収投資助言報酬及び(5)未収収益

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

(6)投資有価証券

投資有価証券は其他有価証券に区分されており、時価については、基準価額によっております。

また、有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照下さい。

負 債

(1)未払手数料、(2)未払費用及び(3)未払法人税等

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

(4)長期未払費用

時価については、支払見込額に基づく現在価値によっております。

デリバティブ取引

「デリバティブ取引関係」注記を参照下さい。

(有価証券関係)

当中間会計期間末（平成25年9月30日）

その他有価証券

(単位:千円)

| | 種類 | 中間貸借対照表 計上額 | 取得原価 | 差額 |
|----------------------------|-----|----------------|--------|----|
| 中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えるもの | その他 | 17,188 | 17,100 | 88 |
| 中間貸借対照表計上額が 取得原価を超えないもの | その他 | 198 | 200 | 1 |
| 合計 | | 17,387 | 17,300 | 87 |

当期中に売却したその他有価証券

(単位:千円)

| 区分 | 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
|-----|-------|---------|---------|
| その他 | 1,175 | 287 | - |
| 合計 | 1,175 | 287 | - |

(デリバティブ取引関係)

当中間会計期間末（平成25年9月30日）

ヘッジ会計が適用されていないもの

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引について、取引の対象物は通貨のみであり、中間貸借対照表日における契約額又は契約において定められた元本相当額、時価及び評価損益並びに当該時価の算定方法は、次のとおりであります。

通貨関連（時価の算定方法は、先物為替相場によっております。）

(単位:千円)

| 区分 | | 契約額等 | うち1年超 | 時価 | 評価損益 |
|-----------|--------------|-----------|-------|--------|--------|
| | | | | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 売建 | 521,991 | - | 8,509 | 8,509 |
| | 米ドル | | | | |
| | 買建 | 624,892 | - | 5,983 | 5,983 |
| | ユーロ | | | | |
| 米ドル | | | | | |
| シンガポールドル | 68,703 | - | 94 | 94 | |
| 合計 | | 1,365,262 | - | 13,480 | 13,480 |

(セグメント情報等)

セグメント情報

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

当社は資産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。

関連情報

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

当社は有形固定資産を保有していないため、記載しておりません。

3. 主要な顧客ごとの情報

当社の主要な顧客は一般投資家であり、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める顧客が存在しないため記載を省略しております。

報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

当中間会計期間（自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

| | 当中間会計期間末 (平成25年9月30日) |
|--------------|--------------------------|
| 1株当たり純資産額 | 91,719円57銭 |
| 1株当たり中間純利益金額 | 10,326円03銭 |

- (注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在していないため記載しておりません。
2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

| | 当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日) |
|--------------------|--|
| 中間純利益金額(千円) | 635,670 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円) | - |
| 普通株式に係る中間純利益金額(千円) | 635,670 |
| 普通株式の期中平均株式数(株) | 61,560 |

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】

本項を以下の記載内容に更新・訂正します。

<更新・訂正後>

受託会社

名 称 株式会社りそな銀行
 資本金の額 279,928百万円（平成25年9月末現在）
 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

<参考>再信託受託会社の概要

名 称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
 資本金の額 51,000百万円（平成25年9月末現在）
 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。
 関係業務の概要 受託会社より委託を受け、当ファンドの信託事務の一部（信託財産の管理等）を行います。

販売会社

| 名称 | 資本金の額 | 事業の内容 |
|---------------|----------------------------|--------------------|
| 株式会社池田泉州銀行 | 50,710百万円 (平成25年9月末現在) | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| シティバンク銀行株式会社 | 123,100百万円 (平成25年9月末現在) | |
| 株式会社ジャパンネット銀行 | 37,250百万円 (平成25年9月末現在) | |

| | | |
|--------------------|----------------------------|---------------------------------------|
| 岡三証券株式会社 | 5,000百万円 (平成25年10月末現在) | 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。 |
| 岩井コスモ証券株式会社 | 13,500百万円 (平成25年3月末現在) | |
| S M B C 日興証券株式会社 | 10,000百万円 (平成25年9月末現在) | |
| 野村證券株式会社 | 10,000百万円 (平成25年9月末現在) | |
| S M B C フレンド証券株式会社 | 27,270百万円 (平成25年3月末現在) | |
| ドイツ証券株式会社 | 72,728百万円 (平成25年5月1日現在) | |
| みずほ証券株式会社 | 125,167百万円 (平成25年9月末現在) | |
| 東海東京証券株式会社 | 6,000百万円 (平成25年3月末現在) | |
| ニュース証券株式会社 | 877百万円 (平成25年11月末現在) | |
| ばんせい証券株式会社 | 1,558百万円 (平成25年12月末現在) | |
| 楽天証券株式会社 | 7,495百万円 (平成25年3月末現在) | |
| 株式会社 S B I 証券 | 47,937百万円 (平成25年9月末現在) | |
| エイチ・エス証券株式会社 | 3,000百万円 (平成25年3月末現在) | |
| 岡三オンライン証券株式会社 | 8,000百万円 (平成25年3月末現在) | |
| 中銀証券株式会社 | 2,000百万円 (平成25年3月末現在) | |
| 高木証券株式会社 | 11,069百万円 (平成25年9月末現在) | |
| マネックス証券株式会社 | 7,425百万円 (平成25年9月末現在) | |
| カブドットコム証券株式会社 | 7,196百万円 (平成25年9月末現在) | |
| 池田泉州 T T 証券株式会社 | 1,250百万円 (平成25年9月2日現在) | |
| 三井生命保険株式会社 | 167,280百万円 (平成25年9月末現在) | 保険業法に基づき生命保険業を 営んでいます。 |

| | | |
|--------------|----------------------------|--|
| 三井住友信託銀行株式会社 | 342,037百万円 (平成25年3月末現在) | 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。 |
|--------------|----------------------------|--|

新規申込みの取扱いを行いません。

投資顧問会社

名称 ドイチェ・アセット&ウェルス・マネジメント・インベストメントGmbH
資本金の額 11,500万ユーロ(約167億円)(平成25年3月末現在)
事業の内容 有価証券等に係る投資顧問業及びその業務に付帯関連する一切の業務を営んでいます。

(注)ユーロの円換算は、便宜上、平成25年12月末現在の株式会社三菱東京UFJ銀行の対顧客電信売買相場の仲値(1ユーロ=145.05円)によります。

独立監査人の監査報告書

平成25年12月18日

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社
取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進
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」に掲げられているドイチェ・ロシア東欧株式ファンドの平成25年5月21日から平成25年11月18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、ドイチェ・ロシア東欧株式ファンドの平成25年11月18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

ドイチェ・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. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年12月6日

ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 野島 浩一郎

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、「経理の状況」に掲げられているドイチェ・アセット・マネジメント株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、ドイチェ・アセット・マネジメント株式会社の平成25年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了する中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

() 上記は、当社が、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。