

【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3月10日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 白川 真

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【事務連絡者氏名】 山部 努
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03-5555-3111

【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券に係る
ファンドの名称】 ダイワファンドラップ 日本株式セレクト
ダイワファンドラップ 日本債券セレクト
ダイワファンドラップ 外国株式セレクト
ダイワファンドラップ 外国株式セレクト エマージングプラス
ダイワファンドラップ 外国債券セレクト
ダイワファンドラップ 外国債券セレクト エマージングプラス
ダイワファンドラップ J-REITセレクト
ダイワファンドラップ 外国REITセレクト
ダイワファンドラップ コモディティセレクト
ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト
(総称を「ダイワファンドラップ専用投資信託」とします。)

【届出の対象とした募集内
国投資信託受益証券の金
額】 継続申込期間（平成25年9月11日から平成26年9月9日まで）
各ファンドについて10兆円を上限とし、合計で100兆円を上限
とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成25年9月10日付で提出した「ダイワファンドラップ 日本株式セレクト、ダイワファンドラップ 日本債券セレクト、ダイワファンドラップ 外国株式セレクト、ダイワファンドラップ 外国株式セレクト エマージングプラス、ダイワファンドラップ 外国債券セレクト、ダイワファンドラップ 外国債券セレクト エマージングプラス、ダイワファンドラップ J-REITセレクト、ダイワファンドラップ 外国REITセレクト、ダイワファンドラップ コモディティセレクト、ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト（総称「ダイワファンドラップ専用投資信託」）」有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項を、半期報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

（ 下線部_____は訂正部分を示します。 ）

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】

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成25年6月末日現在） >

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成25年12月末日現在） >

< 略 >

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

< 訂正前 >

主要投資対象

< 略 >

ファンド名	指定投資信託証券
FW日本株式セレクト	ダイワ・バリュー株・オープン（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
	J P M日本株・ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
	ダイワ好配当日本株投信Q（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
	J Flag スモールキャップ・ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
	スピリタス・ディスティレーション・ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）（注）
FW日本債券セレクト	東京海上日本債ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
	マニユライフ日本債券アクティブ・ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
	みずほ信 クレジットアクティブ・ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
	ダイワ日本国債ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）（注）

FW外国株式セレクト	ダイワ海外好配当株ファンドM（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	MFS外国株コア・ファンド（適格機関投資家専用）
	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ロベコ・キャピタル・グロース・ファンズ」が発行する「ロベコ・US・プレミアム・エクイティーズ I USDシェアーズ」の投資証券（米ドル建）
	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ING（L）」が発行する「ING（L）インベスト・ヨーロッパ・オポチュニティーズ」のクラスI投資証券（ユーロ建）
FW外国株式EM+	ダイワ海外好配当株ファンドM（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	UBS BRICsプラス・ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	MFS外国株コア・ファンド（適格機関投資家専用）
	アイルランド籍の外国証券投資法人「ラザード・グローバル・アクティブ・ファンズ・パブリック・リミテッド・カンパニー」が発行する「ラザード・エマージング・マーケッツ・エクイティ・ファンド」の投資証券（米ドル建）
	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ロベコ・キャピタル・グロース・ファンズ」が発行する「ロベコ・US・プレミアム・エクイティーズ I USDシェアーズ」の投資証券（米ドル建）
	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ING（L）」が発行する「ING（L）インベスト・ヨーロッパ・オポチュニティーズ」のクラスI投資証券（ユーロ建）
FW外国債券セレクト	モルガン・スタンレー・グローバル・ボンド・オープンM（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	ベアリング外国債券ファンドM（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	ブラックロック外国債券ファンドM（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ（ケイマン） グローバル総合債券（除く日本）ポートフォリオ クラスB 受益証券（適格機関投資家限定）（ケイマン籍、円建）
FW外国債券EM+	モルガン・スタンレー・グローバル・ボンド・オープンM（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	ベアリング外国債券ファンドM（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	ブラックロック・エマージング・ボンド・ファンドM（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	ブラックロック外国債券ファンドM（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	T・ロウ・プライス新興国債券オープンM（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ（ケイマン） グローバル総合債券（除く日本）ポートフォリオ クラスB 受益証券（適格機関投資家限定）（ケイマン籍、円建）
FWヘッジFセレクト	ダイワ・トピックス・ニュートラル（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	大和住銀FoF用ジャパン・マーケット・ニュートラル（適格機関投資家限定）
	ベアリング トータルリターン ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

上記は、平成25年8月現在の指定投資信託証券の一覧であり、今後、名称変更となる場合、繰上償還等により除外される場合、新たな投資信託証券が追加となる場合等があります。

< 略 >

（注）については、平成25年9月11日に追加予定です。

< 略 >

< 訂正後 >

主要投資対象

< 略 >

ファンド名	指定投資信託証券
FW日本株式セレクト	ダイワ・バリュー株・オープン (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	JPM日本株・ファンド (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	ダイワ好配当日本株投信Q (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	JFlag スモールキャップ・ファンド (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	スピリタス・ディスティレーション・ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)
FW日本債券セレクト	東京海上日本債ファンドM (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	マニユライフ日本債券アクティブ・ファンドM (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	みずほ信 クレジットアクティブ・ファンド (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	ダイワ日本国債ファンド (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
FW外国株式セレクト	ダイワ海外好配当株ファンドM (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	MFS外国株コア・ファンド (適格機関投資家専用)
	ニッセイ/ボストン・カンパニー・米国株 ファンド (F0Fs用) (適格機関投資家専用) (注)
	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ロベコ・キャピタル・グロース・ファンズ」が発行する「ロベコ・US・プレミアム・エクイティーズ I USDシェアーズ」の投資証券 (米ドル建)
	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ING (L)」が発行する「ING (L) インベスト・ヨーロッパ・オポチュニティーズ」のクラスI投資証券 (ユーロ建)
FW外国株式EM+	ダイワ海外好配当株ファンドM (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	UBS BRICsプラス・ファンド (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	MFS外国株コア・ファンド (適格機関投資家専用)
	ニッセイ/ボストン・カンパニー・米国株 ファンド (F0Fs用) (適格機関投資家専用) (注)
	アイルランド籍の外国証券投資法人「ラザード・グローバル・アクティブ・ファンズ・パブリック・リミテッド・カンパニー」が発行する「ラザード・エマージング・マーケッツ・エクイティ・ファンド」の投資証券 (米ドル建)
	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ロベコ・キャピタル・グロース・ファンズ」が発行する「ロベコ・US・プレミアム・エクイティーズ I USDシェアーズ」の投資証券 (米ドル建)
	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ING (L)」が発行する「ING (L) インベスト・ヨーロッパ・オポチュニティーズ」のクラスI投資証券 (ユーロ建)
FW外国債券セレクト	ベアリング外国債券ファンドM (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	ブラックロック外国債券ファンドM (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	LM・ブランディワイン外国債券ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用) (注)
	ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ (ケイマン)
	グローバル総合債券 (除く日本) ポートフォリオ クラスB 受益証券 (適格機関投資家限定) (ケイマン籍、円建)

FW外国債券EM+	ベアリング外国債券ファンドM (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	ブラックロック外国債券ファンドM (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	T・ロウ・プライス新興国債券オープンM (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	ダイワ米ドル建て新興国債券ファンドM (F0Fs用) (適格機関投資家専用) (注)
	LM・ブランディワイン外国債券ファンド(F0Fs用) (適格機関投資家専用) (注)
	ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ(ケイマン) グローバル総合債券(除く日本)ポートフォリオ クラスB 受益証券(適格機関 投資家限定)(ケイマン籍、円建)
FWヘッジFセレクト	ダイワ・トピックス・ニュートラル(F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	大和住銀FoF用ジャパン・マーケット・ニュートラル(適格機関投資家限定)
	T & D米国金利戦略ファンド(F0Fs用) (適格機関投資家専用) (注)
	シンプレクス・イベントドリブン・ファンド(F0Fs用) (適格機関投資家専用) (注)

上記は、平成26年2月現在の指定投資信託証券の一覧であり、今後、名称変更となる場合、繰上償還等により除外される場合、新たな投資信託証券が追加となる場合があります。

< 略 >

(注) については、平成26年3月11日に追加予定です。

< 略 >

(2) 【投資対象】

< 訂正前 >

< 略 >

ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性がある投資先ファンドの内容は、次のとおりです。

< 略 >

< FW日本債券セレクト >

投資先ファンドの名称	東京海上日本債ファンドM (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	東京海上アセットマネジメント投信株式会社

< 略 >

< FW外国株式セレクト >

< 略 >

投資先ファンドの名称	MFS外国株コア・ファンド(適格機関投資家専用)
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ロベコ・キャピタル・グロース・ファンズ」が発行する「ロベコ・US・プレミアム・エクイティーズ I USDシェアーズ」の投資証券(米ドル建)
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

< 略 >

< FW外国株式EM+ >

< 略 >

投資先ファンドの名称	MFS外国株コア・ファンド(適格機関投資家専用)
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	アイルランド籍の外国証券投資法人「ラザード・グローバル・アクティブ・ファンズ・パブリック・リミテッド・カンパニー」が発行する「ラザード・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド」の投資証券(米ドル建)
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

< 略 >

< FW外国債券セレクト >

投資先ファンドの名称	モルガン・スタンレー・グローバル・ボンド・オープンM(FOFs用) (適格機関投資家専用)
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な安定成長を図ることを目的として、安定運用を行うことを基本とします。
主要な投資対象	モルガン・スタンレー・グローバル・ボンド・マザーファンドを通じて、日本を除く世界各国の公社債に投資します。
委託会社の名称	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社

投資先ファンドの名称	ベアリング外国債券ファンドM(FOFs用)(適格機関投資家専用)
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	ブラックロック外国債券ファンドM(FOFs用)(適格機関投資家専用)
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ（ケイマン） グローバル総合債券（除く日本）ポートフォリオ クラスB 受益証券（適格機関投資家限定）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

< FW外国債券EM+ >

投資先ファンドの名称	モルガン・スタンレー・グローバル・ボンド・オープンM（F0Fs用） （適格機関投資家専用）
運用の基本方針	投資信託財産の長期的な安定成長を図ることを目的として、安定運用を行うことを基本とします。
主要な投資対象	モルガン・スタンレー・グローバル・ボンド・マザーファンドを通じて、日本を除く世界各国の公社債に投資します。
委託会社の名称	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社

投資先ファンドの名称	ベアリング外国債券ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	ブラックロック・エマージング・ボンド・ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	投資信託財産の成長と安定した収益の確保を目指して運用を行ないます。
主要な投資対象	ブラックロック・エマージング・ボンド・マザーファンドを通じて、エマージング・マーケット債（国債、政府機関債、社債等）に投資します。エマージング・マーケット債には、エマージング・マーケットの発行体の公社債およびエマージング・マーケットにおいて主要な経済活動を行なっている発行体の公社債が含まれます。
委託会社の名称	ブラックロック・ジャパン株式会社

投資先ファンドの名称	ブラックロック外国債券ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	T・ロウ・プライス新興国債券オープンM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ（ケイマン） グローバル総合債券（除く日本）ポートフォリオ クラスB 受益証券（適格機関投資家限定）
------------	---

運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

< 略 >

< FWヘッジセレクト >

< 略 >

< 略 >

投資先ファンドの名称	大和住銀FoF用ジャパン・マーケット・ニュートラル（適格機関投資家限定）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	ベアリング トータルリターン ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	この投資信託は、市場の動向に関わらず安定的に収益を獲得することを目標として運用を行うことを基本とします。
主要な投資対象	ベアリング ソブリン トータルリターン マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国（新興国を含みます）のソブリン債（国債、国際機関債等）、準ソブリン債（地方債、政府保証債等）に投資を行います。
委託会社の名称	ベアリング投信投資顧問株式会社

くわしくは後掲の「 参考 指定投資信託証券等の概要」をご参照下さい。

平成25年9月10日（提出日）現在、ファンドが純資産総額の10%を超えて投資する可能性があると判断している不動産投資信託証券の銘柄の内容は、次のとおりです。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性がある投資先ファンドの内容は、次のとおりです。

< 略 >

< FW日本債券セレクト >

投資先ファンドの名称	東京海上日本債ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	東京海上アセットマネジメント投信株式会社 平成26年4月1日付で東京海上アセットマネジメント株式会社に商号変更する予定です。

< 略 >

< FW外国株式セレクト >

< 略 >

投資先ファンドの名称	MFS外国株コア・ファンド（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	ニッセイ/ボストン・カンパニー・米国株 ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要な投資対象	ニッセイ/ボストン・カンパニー・米国中型株 マザーファンドおよびニッセイ米国配当成長株 マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、直接株式等に投資を行う場合があります。
委託会社の名称	ニッセイアセットマネジメント株式会社

投資先ファンドの名称	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ロベコ・キャピタル・グロース・ファンズ」が発行する「ロベコ・US・プレミアム・エクイティーズ I USDシェアーズ」の投資証券（米ドル建）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

< 略 >

< FW外国株式EM+ >

< 略 >

投資先ファンドの名称	MFS外国株コア・ファンド（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	ニッセイ/ボストン・カンパニー・米国株 ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要な投資対象	ニッセイ/ボストン・カンパニー・米国中型株 マザーファンドおよびニッセイ米国配当成長株 マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、直接株式等に投資を行う場合があります。
委託会社の名称	ニッセイアセットマネジメント株式会社

投資先ファンドの名称	アイルランド籍の外国証券投資法人「ラザード・グローバル・アクティブ・ファンズ・パブリック・リミテッド・カンパニー」が発行する「ラザード・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド」の投資証券（米ドル建）
------------	---

運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

< 略 >

< FW外国債券セレクト >

投資先ファンドの名称	ベアリング外国債券ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	ブラックロック外国債券ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	LM・ブランディワイン外国債券ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	当ファンドは、主に「LM・ブランディワイン外国債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本を除く世界の公社債に実質的に投資を行うことにより、信託財産の中長期的成長を目指します。
主要な投資対象	LM・ブランディワイン外国債券マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券
委託会社の名称	レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社

投資先ファンドの名称	ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ（ケイマン） グローバル総合債券（除く日本）ポートフォリオ クラスB受益証券（適格機関投資家限定）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

< FW外国債券EM+ >

投資先ファンドの名称	ベアリング外国債券ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	ブラックロック外国債券ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	T・ロウ・プライス新興国債券オープンM (FOFs用) (適格機関投資家専用)
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	ダイワ米ドル建て新興国債券ファンドM (FOFs用) (適格機関投資家専用)
運用の基本方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。
主要な投資対象	新興国債券マザーファンドを通じて、新興国の国家機関が発行する米ドル建ての債券に投資します。
委託会社の名称	大和証券投資信託委託株式会社

投資先ファンドの名称	LM・ブランディワイン外国債券ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)
運用の基本方針	当ファンドは、主に「LM・ブランディワイン外国債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本を除く世界の公社債に実質的に投資を行うことにより、信託財産の中長期的成長を目指します。
主要な投資対象	LM・ブランディワイン外国債券マザーファンド (以下「マザーファンド」といいます。) の受益証券
委託会社の名称	レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社

投資先ファンドの名称	ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ (ケイマン) グローバル総合債券 (除く日本) ポートフォリオ クラスB 受益証券 (適格機関投資家限定)
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

< 略 >

< FWヘッジセレクト >

< 略 >

投資先ファンドの名称	大和住銀FoF用ジャパン・マーケット・ニュートラル (適格機関投資家限定)
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	T & D米国金利戦略ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)
運用の基本方針	市場動向にかかわらず安定した収益の獲得をめざして運用を行ないます。
主要な投資対象	短期金利戦略マザーファンドとイールドカーブ戦略マザーファンドを主な投資対象とします。
委託会社の名称	T & Dアセットマネジメント株式会社

投資先ファンドの名称	シンプレクス・イベントドリブン・ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)
運用の基本方針	信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。
主要な投資対象	日本の株式のうち、主に親子上場の子会社等の株式を主要投資対象とします。
委託会社の名称	シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社

くわしくは後掲の「参考 指定投資信託証券等の概要」をご参照下さい。

平成26年3月10日(提出日)現在、ファンドが純資産総額の10%を超えて投資する可能性があるとして判断している不動産投資信託証券の銘柄の内容は、次のとおりです。

< 略 >

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

< FW外国REITセレクト以外の各ファンド >

< 略 >

上記の運用体制は平成25年7月1日現在のものであり、変更となる場合があります。

< FW外国REITセレクト >

< 略 >

上記の運用体制は平成25年7月1日現在のものであり、変更となる場合があります。

< 訂正後 >

< FW外国REITセレクト以外の各ファンド >

< 略 >

上記の運用体制は平成25年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

< FW外国REITセレクト >

< 略 >

上記の運用体制は平成25年12月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(5) 【投資制限】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 2 投資方針」の末尾の
< 参考 > 指定投資信託証券等の概要」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

< 参考 > 指定投資信託証券等の概要

本項は、「ダイワファンドラップ専用投資信託」が投資を行なう投資信託証券（指定投資信託証券等）の投資態度、信託報酬、関係法人等について、平成26年3月10日（提出日）現在で委託会社が知り得る情報をもとに記載したものであり、記載内容が変更となる場合があります。

今後、名称変更となる場合、繰上償還等により投資信託証券が除外される場合、新たな投資信託証券が追加となる場合等があります。

なお、下記の点については、各投資信託証券に共通となっています。

ファンドの関係法人のうち販売会社：三井住友信託銀行株式会社（ただしDaiwa“RICI”Fund、ラザード・グローバル・アクティブ・ファンズ・パブリック・リミテッド・カンパニー/ラザード・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド、ロベコ・キャピタル・グロース・ファンズ/ロベコ・US・プレミアム・エクイティーズ I USDシェアーズ、ING（L）インベスト・ヨーロッパ・オパチュニティーズ・クラスI、ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ（ケイマン）グローバル総合債券（除く日本）ポートフォリオ クラスB 受益証券（適格機関投資家限定）を除きます。）

- ・指定投資信託証券等の委託会社等については、末尾の「指定投資信託証券等の委託会社等について」をご参照下さい。
- ・指定投資信託証券等の一部の受託会社について、信託事務処理の一部を他の信託銀行に再信託する場合があります。

1. ダイワ・バリュー株・オープン（F0Fs用）（適格機関投資家専用）

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	ダイワ・バリュー株・オープン・マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券
投資態度	<p>マザーファンドの受益証券を通じて、主としてわが国の上場株式を投資対象とし、取得時にPER、PBRなどの指標または株価水準から見て割安と判断される銘柄のうち、今後株価の上昇が期待される銘柄に投資します。ただし、取得した後にこの条件を満たさない銘柄であっても保有を継続することがあります。</p> <p>銘柄の選定にあたっては、主に次の観点から行ないます。</p> <p>イ. 事業の再構築力、新しい事業展開</p> <p>ロ. 本業の技術力、市場展開力</p> <p>ハ. 株主本位の経営姿勢</p> <p>マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の90%程度以上に維持することを基本とします。</p> <p>株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資は、原則として、信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p> <p>当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。</p>
マザーファンドの投資態度	<p>わが国の金融商品取引所()上場株式および店頭登録株式を主要投資対象とします。</p> <p>金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。</p> <p>取得時にPER、PBRなどの指標または株価水準から見て割安と判断される銘柄のうち、今後株価の上昇が期待される銘柄に投資します。ただし、取得した後にこの条件を満たさなくなった銘柄であっても保有を継続することがあります。</p> <p>銘柄の選定にあたっては、主に次の観点から行ないます。</p> <p>イ. 事業の再構築力、新しい事業展開</p> <p>ロ. 本業の技術力、市場展開力</p> <p>ハ. 株主本位の経営姿勢</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>

主な投資制限	マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。 株式への実質投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の株式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10%以下とします。 外貨建資産への投資は、行ないません。
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。 原則として、配当等収益等を中心に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
信託期間	無期限(平成18年11月29日当初設定)
決算日	毎年3月9日および9月9日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.5565% (税抜0.53%)の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年0.5724%となります。
ファンドの 関係法人	委託会社:大和証券投資信託委託株式会社 受託会社:三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	TOPIX(東証株価指数)
ベンチマーク について	・ベンチマークとは、運用成果を判断する基準となるものです。日本株全体のベンチマークとしては、市場全体の動きや構造を反映し普遍的に使用しうるものであるのが望ましいとされており、TOPIXが一般的に使用されています。 ・TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。 ・ベンチマークと当ファンドの基準価額の動きを比較した結果は、運用報告書でお知らせします。 ・なお、将来、ベンチマークとしてTOPIXに代わる指数を使用することが望ましいと一般的にみなされると当社が判断した場合には、ベンチマークを当該指数に変更することがあります。 ・当ファンドは、TOPIXとの連動をめざすものではありません。また、TOPIXを上回る運用成果を保証するものではありません。

2. JPM日本株・ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	主として日本の株式を投資対象とするマザーファンドの受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長をはかることを目的として運用を行います。
主要投資対象	JPM日本株・マザーファンド(適格機関投資家専用)(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券
投資態度	主として、JPM日本株・マザーファンド(適格機関投資家専用)受益証券に投資します。 株式以外の資産(他の投資信託の受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託に属するとみなした部分を含みます。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用が出来ない場合があります。
マザーファンドの 投資態度	日本の株式に投資し、信託財産の中長期的な成長をめざした運用を行います。 ・マザーファンドにおけるアナリストの調査・分析活動においては、「RDP株式運用戦略」独自の業種分類に基づき、調査対象企業の長期的な業績予想を行います。 ・マザーファンドにおけるポートフォリオの構築にあたっては、アナリストやポートフォリオ・マネジャーの定性的な判断(主観的判断)のみに頼ることなく、配当割引モデル(DDM)等を通じてその修正を行います。 ・TOPIX(配当込み)を当ファンドのベンチマークとします。 ・TOPIX(配当込み)に対するリスクを一定水準に保ちつつ、安定した超過収益を積み上げることを目指します。 株式以外の資産への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には上記のような運用が出来ない場合があります。

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産(外国通貨表示の有価証券、預金その他の資産をいいます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>有価証券先物取引等は信託約款に定める範囲で行います。</p>
収益の分配	<p>分配対象額の範囲は、計算期間終了日における、信託約款に定める受益者に分配することができる額と、分配準備積立金の合計額とします。</p> <p>委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。</p>
信託期間	無期限(平成18年11月29日当初設定)
決算日	毎年3、9月の各5日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	<p>信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.6825% (税抜0.65%)の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。</p> <p>消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年0.702%となります。</p>
ファンドの 関係法人	<p>委託会社:JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社</p> <p>受託会社:三井住友信託銀行株式会社</p>
ベンチマーク	TOPIX(配当込み)
ベンチマーク について	<p>TOPIXとは東証株価指数(Tokyo Stock Price Index)のことで、東証市場第一部に上場しているすべての日本企業(内国普通株式全銘柄)を対象とした、時価総額加重型の株価指数です。TOPIXは、1968年1月4日を基準日とし、基準日の時価総額を100ポイントとした場合、現在の時価総額がどの程度かを表します。</p> <p>TOPIX(東証株価指数)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、当ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、当ファンドの発行また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。</p>

3. ダイワ好配当日本株投信Q (F0Fs用) (適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	ダイワ好配当日本株マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券
投資態度	<p>マザーファンドの受益証券を通じて、主としてわが国の金融商品取引所()上場株式に投資し、高水準の配当収入の確保と、値上がり益の獲得をめざします。</p> <p>金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。</p> <p>株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。</p> <p>マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態では高位(信託財産の純資産総額の90%程度以上)に維持することを基本とします。</p> <p>株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資は、原則として、信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>J-REIT(不動産投資信託証券)に投資することがあります。J-REITへの実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。当該J-REITは、外貨建資産を保有する場合があります。外貨建資産への実質投資割合は、原則として、信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p> <p>当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。</p>

マザーファンドの投資態度	<p>主としてわが国の金融商品取引所上場株式(上場予定を含みます。)に投資して、高水準の配当収入の確保と、値上がり益の獲得をめざします。</p> <p>株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。</p> <p>株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。</p> <p>J-REIT(不動産投資信託証券)に投資することがあります。J-REITへの投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。当該J-REITは、外貨建資産を保有する場合があります。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への直接投資は、行ないません。</p>
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。</p> <p>原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。</p>
信託期間	無期限(平成18年9月28日当初設定)
決算日	毎年1、4、7、10月の各5日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	<p>信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.4725% (税抜0.45%)の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。</p> <p>消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年0.486%となります。</p>
ファンドの関係法人	<p>委託会社:大和証券投資信託委託株式会社</p> <p>受託会社:三井住友信託銀行株式会社</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマークについて	該当事項はありません。

4. J Flag スモールキャップ・ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とし、中長期的な信託財産の成長を目指して積極的に運用を行なうことを基本とします。</p> <p>主に時価総額2,000億円以下の上場株式を投資対象とします。</p> <p>運用の効率化をはかるため株価指数先物取引等を利用することがあります。</p> <p>大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p> <p>当ファンドは、原則としてファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。ただし、わが国の金融商品取引所に上場している不動産投資信託証券への投資は行いません。</p> <p>株式以外の資産への投資は、原則として、信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行ないません。</p> <p>派生商品の利用はヘッジ目的に限定します。</p>
収益の分配	<p>収益分配対象額の範囲は、経費等控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価損益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、収益分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。</p>

信託期間	無期限(平成23年2月10日当初設定)
決算日	毎年3月20日および9月20日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.861%（税抜0.82%）の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、運用報告書の作成費用、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年0.8856%となります。
ファンドの 関係法人	委託会社: シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社 受託会社: 三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマーク について	該当事項はありません。

5. スピリタス・ディスティレーション・ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	シンプレクス・スピリタス・ディスティレーション・マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とし、中長期的な信託財産の成長を目指して積極的に運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	主に、マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式に、中長期的な信託財産の成長を目指して積極的に投資し、中長期的な値上がり益の追求を目指します。 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用ができない場合があります。 当ファンドは、原則としてファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。
主な投資制限	マザーファンドの受益証券の投資割合には制限を設けません。 株式への実質投資割合には制限を設けません。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 マザーファンドを除く投資信託証券への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。ただし、わが国の金融商品取引所に上場している不動産投資信託証券への投資は行ないません。 株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産の属する部分を含みます。)への実質投資割合は、原則として、信託財産総額の50%以下とします。 外貨建資産への投資は、行ないません。 デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。
収益の分配	収益分配対象額の範囲は、経費等控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価損益を含みます。)等の全額とします。 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、収益分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
信託期間	無期限(平成25年9月10日当初設定)
決算日	毎年3月20日および9月20日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.840%（税抜0.80%）の率を乗じて得た額とします。他に組入る有価証券や派生商品等の売買の際に発生する売買委託手数料、受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、随時、信託財産中から支弁します。 信託の計理およびこれに付随する業務や法定書類の作成・交付に要する費用等(これらの業務を外部に委託する場合も含まれます。)、また、信託の監査人および法律顧問等に対する報酬や費用等も信託財産中から支弁されます。 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年0.864%となります。
ファンドの 関係法人	委託会社: シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社 受託会社: 三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	該当事項はありません。

ベンチマークについて	該当事項はありません。
------------	-------------

6. 東京海上日本債ファンドM（F0Fs用）（適格機関投資家専用）

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	当社が年金運用でつちかったノウハウを最大限に活用し、主として以下の方針で運用を行う「TMA日本債券マザーファンド受益証券」に投資します。 安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目標とし、日本の債券に投資します。 NOMURA - BPI(総合)をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。
主要投資対象	TMA日本債券マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券
投資態度	主として日本の債券を主要投資対象として運用するマザーファンド受益証券に投資します。 NOMURA - BPI(総合)をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目標とします。 当ファンドの運用は、ファミリーファンド方式により行います。従って、実質的な運用は、マザーファンドで行うこととなります。 ただし、資金動向、市況動向、残存期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。
マザーファンドの投資態度	当社が年金運用でつちかったノウハウを最大限に活用し、以下の方針で臨みます。 ポートフォリオは、イールド選択(金利選択)、スプレッド選択および銘柄選択を付加価値の源泉として構築します。 イールド選択(金利選択) 金融政策やインフレ指標等の分析から長短金利の方向性を予測し、たとえば金利低下を予測する場合はデュレーション*を長期化、金利上昇を予測する場合はデュレーションを短期化する戦略をとります。 *デュレーションとは、金利の変化に対する債券価格の変動性を示す指標です。その値が大きいほど、金利の変化に対して価格の動きが大きいことを意味します。 スプレッド選択 債券の信用度や流動性等の分析によりスプレッド(国債との利回り較差。信用度が低い企業の発行する債券は国債に比べて、より利回りが高い)の妥当性や変化の方向性を見定め、スプレッド縮小を予測する場合は、スプレッド縮小の恩恵を得られる社債等の比率を高めるなどの戦略をとります。 銘柄選択 債券の残存期間と最終利回りの関係を分析し、相対的に高利回りな銘柄を選別します。社債等においては、ファンドマネージャーによる企業訪問で得た情報等を分析し銘柄を選択します。基本的には債券への組入比率を高位に保ちますが、資金動向、市況動向によっては実質債券組入比率の調整を機動的に行います。 有価証券等の価格変動リスクを回避するため、日本において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における日本の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことがあります。また、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(スワップ取引)を行うことがあります。 大量の追加設定または解約が生じたとき、市況の急激な変化が予想されるとき、ならびに信託財産の規模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。
主な投資制限	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。(ただし、転換社債の転換、新株引受権の行使および新株予約権の行使により取得する場合に限ります。) 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%以下とします。 マザーファンド受益証券を除く投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 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20%以下とします。 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20%以下とします。 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

収益の分配	毎決算時に、原則として次の方針に基づき分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 収益分配にあたっては、原則として毎決算時に安定した分配を継続的に行うことを目指すものとし、収益分配金額は委託者が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。
信託期間	無期限(平成20年8月12日当初設定)
決算日	毎月5日(第1計算期間は、平成20年9月5日(金)まで)(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.315%(税抜0.30%)の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年0.324%となります。
ファンドの 関係法人	委託会社:東京海上アセットマネジメント投信株式会社 平成26年4月1日付で東京海上アセットマネジメント株式会社に商号変更する予定です。 受託会社:三菱UFJ信託銀行株式会社
申込手数料	ありません。
ベンチマーク	NOMURA - BPI(総合)
ベンチマーク について	NOMURA - BPI(野村ボンド・パフォーマンス・インデックス)(総合)とは、野村証券が公表する日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。NOMURA - BPIは、野村証券の知的財産です。野村証券は、当ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。

7. マニユライフ日本債券アクティブ・ファンドM (FOFs用) (適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	主としてわが国の公社債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてマニユライフ日本債券アクティブ・マザーファンド(以下、「マザーファンド」といいます。)受益証券に投資します。なお、コマーシャル・ペーパーなど短期金融商品等に直接投資する場合があります。
投資態度	マザーファンド受益証券を主たる投資対象とします。 NOMURA-BPI総合をベンチマークとして、円建て公社債(ユーロ円債を含む)のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的に同指標を上回る運用を目指します。 マザーファンドの受益証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 マザーファンドの運用にあたっては、委託者の関連会社である投資運用業者、マニユライフ・アセット・マネジメント株式会社に運用の指図に関する権限の一部を委託します。 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行われないことがあります。
マザーファンドの 投資態度	NOMURA-BPI総合をベンチマークとして、円建て公社債(ユーロ円債を含む)のうち、主として投資適格債券に投資することによって、中長期的に同指標を上回る運用を目指します。 運用の効率化をはかるため債券先物取引等を利用することがあります。 公社債の組入れ比率は原則として高位を維持します。 委託者の関連会社である投資運用業者、マニユライフ・アセット・マネジメント株式会社に運用の指図に関する権限の一部を委託します。 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行われないことがあります。
主な投資制限	債券への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。 有価証券先物取引等の直接利用は行いません。 信用取引、空売り、有価証券の貸付・借入れは行いません。 投資信託証券(マザーファンド受益証券を除く)への投資は行いません。
収益の分配	分配対象額の範囲 繰越控除分を含めた経費控除後の利子・配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 分配対象額についての分配方針 分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。 留保益の運用方針 収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。

信託期間	無期限(平成23年3月8日当初設定)
決算日	毎月5日(休業日の場合は翌営業日)
管理報酬等	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.315%（税抜0.3%）の率を乗じて得た額とします。ほかに監査費用、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年0.324%となります。
ファンドの関係法人	委託会社: マニユライフ・インベストメンツ・ジャパン株式会社 受託会社: 三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
ベンチマークについて	NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、国債の他、地方債、政府保証債、金融債、事業債および円建外債等で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デューレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI総合は野村證券株式会社の知的財産であり、当ファンドの運用成果に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。

8. みずほ信 クレジットアクティブ・ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	みずほ信託銀行株式会社が長年の年金運用で培った事業債運用のスキル・ノウハウを活用し、安定的な収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目指します。
主要投資対象	公社債を主要な投資対象とします。
投資態度	<p>原則として公社債の組み入れは高位を目指します。</p> <p>当ファンドは、原則として最長20年程度までの国債を中心としたポートフォリオと、事業債を中心とするポートフォリオで構成します。</p> <p>事業債を中心とするポートフォリオの組み入れ比率は、原則として信託財産の純資産総額に対して60%とします。</p> <p>事業債の組み入れ銘柄の選定にあたっては、対国債スプレッドの伸縮が信用力要因・市場要因で起こり得るとの認識から、これらに影響を与える評価項目を具体的に絞り込み、トップダウン・ボトムアップ両面でリサーチを詳細に実施することにより、分析の精度を高めめます。</p> <p>運用の効率化をはかる目的でクレジット・デフォルト・スワップ取引や債券先物等を利用することがあります。</p> <p>大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p> <p>運用にあたっては、みずほ信託銀行株式会社に運用の指図に関する権限の一部を委託します。</p>
主な投資制限	<p>投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>債券への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>派生商品の利用目的はヘッジ目的に限定しません。</p>
収益の分配	<p>収益分配対象額の範囲は、経費等控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価損益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、収益分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。</p>
信託期間	無期限(平成23年9月9日当初設定)
決算日	毎年3月20日および9月20日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.42%（税抜0.40%）の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年0.432%となります。
ファンドの関係法人	委託会社: シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社 受託会社: 資産管理サービス信託銀行株式会社
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマークについて	該当事項はありません。

9. ダイワ日本国債ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	ダイワ日本国債マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券
投資態度	<p>主としてマザーファンドの受益証券を通じて、わが国の国債に投資し、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。</p> <p>わが国の国債への投資にあたっては、原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間ごとの投資金額がほぼ同程度となるように組み入れます。</p> <p>運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債およびマザーファンドの受益証券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p> <p>当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。</p>
マザーファンドの投資態度	<p>主としてわが国の国債に投資し、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。</p> <p>わが国の国債への投資にあたっては、原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間毎の投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。</p> <p>国債の組入れは原則として高位を保ちます。</p> <p>運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換及び転換社債型新株予約権付社債の新株予約権行使等により取得したものにのみかぎります。</p> <p>株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行ないません。</p>
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。</p> <p>原則として、配当等収益の中から分配します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。</p>
信託期間	無期限(平成25年9月11日当初設定)
決算日	毎年3月10日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	<p>信託報酬の総額は、純資産総額に対して年率0.315%(税抜0.30%)以内とします。</p> <p>消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率0.324%となります。</p> <p>前 の信託報酬率は、毎月10日(休業日の場合翌営業日)(当初設定日から平成25年10月10日(休業日の場合翌営業日)までの期間については当初設定日の前営業日)における新発10年国債の利回り(日本相互証券株式会社発表の終値)に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。(新発10年国債の利回りが)</p> <p>イ. 2%未満の場合 …年率0.147%(税抜0.14%)</p> <p>ロ. 2%以上3%未満の場合 …年率0.189%(税抜0.18%)</p> <p>ハ. 3%以上4%未満の場合 …年率0.231%(税抜0.22%)</p> <p>ニ. 4%以上5%未満の場合 …年率0.273%(税抜0.26%)</p> <p>ホ. 5%以上の場合 …年率0.315%(税抜0.30%)</p> <p>消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、以下の率となります。</p> <p>(新発10年国債の利回りが)</p> <p>イ. 2%未満の場合 …年率0.1512%</p> <p>ロ. 2%以上3%未満の場合 …年率0.1944%</p> <p>ハ. 3%以上4%未満の場合 …年率0.2376%</p> <p>ニ. 4%以上5%未満の場合 …年率0.2808%</p> <p>ホ. 5%以上の場合 …年率0.324%</p>

ファンドの 関係法人	委託会社:大和証券投資信託委託株式会社 受託会社:三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマーク について	該当事項はありません。

10. ダイワ海外好配当株ファンドM (FOFs用) (適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	ダイワ海外好配当株マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券
投資態度	<p>マザーファンドを通じて、主として海外の金融商品取引所()上場株式(上場予定を含みます。)および店頭登録株式(登録予定を含みます。)を投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と株式の値上がり益の獲得により信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。</p> <p>金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。</p> <p>投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。</p> <p>イ. アメリカ、ヨーロッパ、アジア・オセアニアの3地域に均等に投資することを基本とします。</p> <p>ロ. 定量分析データ(S & P社クオリティランキング等)を参考に、配当の質の高い企業を選定します。</p> <p>ハ. 配当利回りの水準、時価総額規模、流動性を勘案します。</p> <p>ニ. 定性分析に基づき利益や配当の継続性を考慮します。</p> <p>マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の90%程度以上に維持することを基本とします。</p> <p>保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p> <p>当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。</p>
マザーファンドの 投資態度	<p>主として海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式(上場予定および店頭登録予定を含みます。)を投資対象とし、安定的な配当等収益の確保と株式の値上がり益の獲得により信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。</p> <p>投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。</p> <p>イ. アメリカ、ヨーロッパ、アジア・オセアニアの3地域に均等に投資することを基本とします。</p> <p>ロ. 定量分析データ(S & P社クオリティランキング等)を参考に、配当の質の高い企業を選定します。</p> <p>ハ. 配当利回りの水準、時価総額規模、流動性を勘案します。</p> <p>ニ. 定性分析に基づき利益や配当の継続性を考慮します。</p> <p>株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。</p> <p>保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p>
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。</p> <p>原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。</p>
信託期間	無期限(平成18年11月29日当初設定)
決算日	毎月9日(第1計算期間は平成19年1月9日まで)(休業日の場合翌営業日)

管理報酬等	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.735%（税抜0.70%）の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年0.756%となります。
ファンドの 関係法人	委託会社：大和証券投資信託委託株式会社 受託会社：三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマーク について	該当事項はありません。
その他	「Standard & Poor's」、 [®] 「S & P」、 [®] 「S & P Quality Rankings」、 [®] 「S & P International Quality Rankings」は、スタンダード・プアーズ・ファイナンシャル・サービスズ・エル・エル・シーの登録商標であり、本商品の提供者である大和証券投資信託委託株式会社に対しては、その利用許諾が与えられています。スタンダード・プアーズは、本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に関し、いかなる意思表示等を行なうものではありません。スタンダード・プアーズは、大和証券投資信託委託株式会社や本商品の投資家およびその他いかなる者に対しても、S & P Quality RankingsおよびS & P International Quality Rankingsその付随データの利用による結果に対して、明示的にも暗示的にも何ら保証等を行なうものではありません。スタンダード・プアーズは、S & P Quality RankingsおよびS & P International Quality Rankingsの利用や投資目的への適合性やその販売性等に関し、一切の保証等を行なうものではないことを明示的に表明しています。

11．MFS外国株コア・ファンド（適格機関投資家専用）

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	「MFS外国株 マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)」受益証券を主要な投資対象とします。
投資態度	主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く世界の株式を主要投資対象とし、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。 マザーファンドでは、市場平均以上の成長性があり、かつ割安な銘柄を厳選して投資を行います。 ベンチマークはMSCI コクサイ・インデックス(税引前配当込み・円ベース)とします。 株式の実質組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。 投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行う場合があります。 投資信託財産に属する実質外貨建資産については、原則として、為替ヘッジを行いません。 マサチューセッツ・ファイナンシャル・サービスズ・カンパニーにマザーファンドの運用の指図に関する権限を委託します(国内の短期金融資産の運用の指図に係る権限を除きます。) 当初設定後一定期間、および資金動向、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。
マザーファンドの 投資態度	日本を除く世界の株式を主要投資対象とし、投資信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。 市場平均以上の成長性があり、かつ割安な銘柄を厳選して投資を行います。 ベンチマークはMSCI コクサイ・インデックス(税引前配当込み・円ベース)とします。 株式の組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。 投資信託財産に属する資産の価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行う場合があります。 投資信託財産に属する外貨建資産については、原則として、為替ヘッジを行いません。 マサチューセッツ・ファイナンシャル・サービスズ・カンパニーに運用の指図に関する権限を委託します(国内の短期金融資産の運用の指図に係る権限を除きます。) 当初設定後一定期間、および資金動向、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。
主な投資制限	株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益(マザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額を含みます。)および売買益(評価損益を含みます。ただし、マザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額を除きます。)等の合計額とします。</p> <p>分配金額については、上記の範囲内で委託者が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合や委託者の判断によって分配を行わないことがあります。</p> <p>収益分配に充てず投資信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて元本と同一の運用を行います。</p>
信託期間	無期限(平成24年3月7日当初設定)
決算日	毎年10月20日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	<p>信託報酬の総額は、投資信託財産の純資産総額に年0.882%(税抜0.84%)の率を乗じて得た額とします。他に監査費用、有価証券売買時の売買委託手数料等が投資信託財産から支払われます。</p> <p>消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年0.9072%となります。</p>
ファンドの関係法人	<p>委託会社:MFSインベストメント・マネジメント株式会社</p> <p>受託会社:三井住友信託銀行株式会社</p> <p>マザーファンドの投資顧問会社:マサチューセッツ・ファイナンシャル・サービスズ・カンパニー</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス(税引前配当込み・円ベース)
ベンチマークについて	<p>MSCIコクサイ・インデックス(税引前配当込み・円ベース)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要国で構成されているインデックスを円換算したものです。</p> <p>また、MSCIコクサイ・インデックスはMSCI Inc.の財産であり、「MSCI」はMSCI Inc.のサービスマークです。</p>

12. ニッセイノボストン・カンパニー・米国株ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。
主要投資対象	ニッセイノボストン・カンパニー・米国中型株 マザーファンドおよびニッセイ米国配当成長株 マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、直接株式等に投資を行う場合があります。
投資態度	<p>主として、上記各マザーファンドの受益証券への投資を通じて、実質的に米国の株式に投資することにより、信託財産の中長期的な成長をめざします。</p> <p>各マザーファンドへの基本投資配分は、以下の通りとします。</p> <p>ニッセイノボストン・カンパニー・米国中型株 マザーファンド : 70%</p> <p>ニッセイ米国配当成長株 マザーファンド : 30%</p> <p>各マザーファンドへの実際の投資比率は、定期的に基本資産配分への見直しを行います。ただし、実際の投資比率と基本投資配分との乖離が一定範囲内の時には、見直しを行わない場合があります。</p> <p>上記マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位に保ちます。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>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。</p>

マザーファンドの投資態度	<p><ニッセイ/ボストン・カンパニー・米国中型株 マザーファンド> 主として米国の中型株の中から、ファンダメンタル分析に基づき算出した本源的価値と比較して株価が割安な銘柄に投資を行います。 運用にあたっては、「ザ・ボストン・カンパニー・アセット・マネジメント・エル・エル・シー」に運用指図に関する権限(国内の短期金融資産の指図に関する権限を除きます。)を委託します。 ラッセル中型株インデックス(円換算ベース)をベンチマークとし、長期的な観点からこれを上回ることを目標とした運用を行います。 株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 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。</p> <p><ニッセイ米国配当成長株 マザーファンド> 主として米国の株式のうち、長期にわたる連続増配銘柄に投資を行います。 投資にあたっては、配当実績、利益や配当の継続性、時価総額規模、流動性等を勘案して運用を行うことを基本とします。 株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 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。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。 同一銘柄の株式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10%以下とします。 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20%以下とします。 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5%以下とします。 同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券(各マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券等を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 外国為替予約取引およびデリバティブ取引の利用は、ヘッジ目的に限定しません。</p>
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の配当等収益(各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。)および売買益(評価益を含みます。ただし、各マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を除きます。)等とします。 委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。</p>
信託期間	無期限(平成26年3月7日当初設定)
決算日	毎年3月5日(第1計算期間は平成27年3月5日まで)(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	<p>信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年率0.9198%(税抜0.876%)の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率0.94608%となります。</p>
ファンドの関係法人	<p>委託会社:ニッセイアセットマネジメント株式会社 受託会社:三井住友信託銀行株式会社 ニッセイ/ボストン・カンパニー・米国中型株 マザーファンドの投資顧問会社: ザ・ボストン・カンパニー・アセット・マネジメント・エル・エル・シー</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマークについて	該当事項はありません。

13. ロベコ・キャピタル・グロース・ファンズ/ロベコ・US・プレミアム・エクイティーズ I USDシェアーズ

形態/表示通貨	ルクセンブルク籍外国投資証券/米ドル建て
運用の基本方針	米国における上場および店頭登録株式を主な投資対象として、長期的な資産の成長を追求します。
主要投資対象	主に米国の発行体が発行する株式、株式関連証券に投資します(外国企業が米国で発行するADRおよび米国を主要取引所とする外国企業が発行する株式、株式関連証券にも投資する場合があります)。また、社債、転換可能債券、デリバティブに係る権利などに投資することもあります。
投資態度	主に米国籍企業、または事業活動の大半を米国で行っている企業等への投資を通じ、長期的な元本の成長を目的として運用を行います。 投資対象の選定に当たっては、魅力的なバリュエーションおよび変化へのカタリストを有している銘柄に着目し、個別銘柄の時価総額については大型株、中型株、小型株のいずれをも投資対象としています。
主な投資制限	現金等の資産には純資産総額の5%を超えて投資しません。 同一発行体により発行された証券へは純資産総額の5%を超えて投資しません。
収益の分配	経費控除後の配当等収益は再投資され、分配は行いません。
信託期間	無期限(平成17年10月3日当初設定)
決算日	毎年12月31日
管理報酬等	マネジメント・フィー:年率0.70% サービス・フィー:年率0.08%(上限) カストディー・フィー:年率0.04%(平均) その他費用:ルクセンブルク年次税0.01%
ファンドの関係法人	管理会社:ロベコ・ルクセンブルク・エスエー 投資顧問会社:ロベコ・インスティテューショナル・アセット・マネジメント・ビーヴィー 副投資顧問会社:ロベコ・インベストメント・マネジメント・インク
ベンチマーク	ラッセル3000バリュエーション指数
ベンチマークについて	ラッセル3000バリュエーション指数は、ラッセル・インベストメンツ社が、時価総額の観点から上位3,000社の主要な米国企業の中で低い株価純資産倍率および低い長期業績予想値の特徴を有する銘柄のパフォーマンスを計測した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はラッセル・インベストメンツ社に帰属し、同社は、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。

14. ING(L) インベスト・ヨーロッパ・オポチュニティーズ - クラス I

形態/表示通貨	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人 / ユーロ建
運用の基本方針	ヨーロッパ株式へ投資することにより、長期的にキャピタルゲインの獲得を目指して運用を行います。
主要投資対象	ヨーロッパ株式を主要投資対象とします。
投資態度	ヨーロッパにおいて設立、上場、取引されている企業の株式を主要投資対象とします。また、ロシアの株式へ投資することがあります。 ヨーロッパ株式へ投資することにより、長期的にキャピタルゲインの獲得を目指して運用を行います。 資金動向や市況動向によっては、上記のような運用を行わない場合があります。
主な投資制限	原則として、純資産総額の3分の2以上をヨーロッパの株式等に投資します。 ロシア株式への投資は純資産総額の25%を上限とします。 一銘柄への投資比率は純資産総額の10%を上限とします。
収益の分配	収益の分配は行いません。
信託期間	無期限
決算日	原則として9月30日です。
管理報酬等	運用報酬最大年率0.6%、固定サービス費用年率0.2%。ルクセンブルグの「the Luxembourg tax d'abonnement(サブスクリプション・タックス)」年率0.01%。 その他の費用・手数料として、有価証券売買手数料、ルクセンブルグの「the Luxembourg tax d'abonnement(サブスクリプション・タックス)以外の税金、臨時費用やその他の費用・手数料はファンド負担となります。

ファンドの 関係法人	管理会社: アイエヌジー・インベストメント・マネジメント・ルクセンブルグS.A. 運用会社: アイエヌジー・アセット・マネジメントB.V. 保管銀行兼登録・名義書換代行会社: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン(ルクセンブルグ)エス・シー・ エー
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマーク について	該当事項はありません。

15. UBS BRICsプラス・ファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	主としてBRICs諸国・地域(ブラジル、ロシア・東欧、インド、中華圏(中国、香港、台湾))の株式を 主要投資対象として、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	UBSニュー・メジャー・エコノミーズ株式マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	UBSニュー・メジャー・エコノミーズ株式マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受 益証券を主要投資対象とします。なお、世界の株式等に直接投資することがあります。 原則としてマザーファンド受益証券を通じて、主としてBRICs諸国・地域(ブラジル、ロシア・東 欧、インド、中華圏(中国、香港、台湾))の株式(ADRおよびGDRを含みます。)に投資するこ とにより、投資元本の成長を目指します。 投資プロセスは、個別銘柄選択、業種配分、国別配分、通貨配分の4つの側面から成ります。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 市場のバリュエーションが極端に割高となった場合や、カントリー・リスクが発生した場合など は、一時的にファンド資産の大部分を流動資産に投資することがあります。 マザーファンド受益証券の組入れについては、高位を維持することを基本とします。 資金動向、信託財産の規模、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。
マザーファンドの 投資態度	この投資信託は、今後高い経済成長が見込まれる、主としてBRICs諸国・地域(ブラジル、ロシ ア・東欧、インド、中華圏(中国、香港、台湾))の株式(ADRおよびGDRを含みます。)に投資 することにより、投資元本の成長を目指します。 投資プロセスは、個別銘柄選択、業種配分、国別配分、通貨配分の4つの側面から成ります。 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 市場のバリュエーションが極端に割高となった場合や、カントリー・リスクが発生した場合など は、一時的にファンド資産の大部分を流動資産に投資することがあります。 資金動向、市況動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。 運用については、UBSグローバル・アセット・マネジメント(シンガポール)リミテッド及びUBS AG、 UBSグローバル・アセット・マネジメント(チューリッヒ)に運用指図に関する権限を委託します。
主な投資制限	株式への実質投資割合には制限を設けません。 新株引受権証券および新株予約権付証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の 20%以内とします。 投資信託証券(マザーファンドを除きます。)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。 同一銘柄の株式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30%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付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10%以内とします。 同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付証券のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当 該新株予約権付証券についての社債であって当該社債と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。)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10%以内とします。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

収益の分配	<p>毎決算時(毎年4月25日。ただし、休業日の場合は翌営業日とします。)に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益(マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額(以下、「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。以下同じ。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額をいいます。以下同じ。)等の全額とします。</p> <p>収益分配金額は、上記の範囲内で、市況動向等を勘案して決定します。ただし、委託者の判断で、分配を行わない場合があります。</p> <p>収益の分配にあてなかった利益については特に制限を定めず、運用の基本方針に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託期間	無期限(平成20年6月3日設定)
決算日	毎年4月25日(休業日の場合は翌営業日)
管理報酬等	<p>信託報酬は、信託財産の純資産総額に年率0.9975%(税抜年0.95%)を乗じて得た額とします。他に監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。委託会社の受ける報酬には、マザーファンドの運用委託に係る投資顧問会社への報酬が含まれません。</p> <p>消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率1.026%となります。</p>
ファンドの関係法人	<p>委託会社:ユービーエス・グローバル・アセット・マネジメント株式会社 受託会社:三井住友信託銀行株式会社 マザーファンドの投資顧問会社: UBSグローバル・アセット・マネジメント(シンガポール)リミテッド UBS AG、UBSグローバル・アセット・マネジメント(チューリッヒ)</p>
ベンチマーク	当該事項はありません。
ベンチマークについて	当該事項はありません。

16. ラザード・グローバル・アクティブ・ファンズ・パブリック・リミテッド・カンパニー/ラザード・エマージング・マーケット・エクィティ・ファンド

形態/表示通貨	アイルランド籍の外国証券投資法人/米ドル建
運用の基本方針	長期的な信託財産の成長をめざし運用を行います。
主要投資対象	新興諸国における上場および店頭登録株式を主な投資対象とします。
投資態度	<p>主として世界の新興国の株式(預託証券を含みます)に投資することにより、信託財産の成長をめざします。</p> <p>MSCI エマージング・マーケット・インデックスをアウトパフォームすることをめざします。ボトムアップの相対バリュウの投資哲学に基づく銘柄選択アプローチを採用しています。定量的なスクリーニングを行い、過去のリターンと株価の関係を分析し、長期的な相対バリュウに注目します。</p> <p>企業の財務諸表(損益計算書、キャッシュ・フロー計算書、貸借対照表、追記)を分析した後、該当業種内の比較検証や、投資に適さない投資機会の判断を行います。</p> <p>ファンダメンタル分析を行い、今後3年間の企業収益、営業利益率、株主資本利益率(ROE)の予想、株価の再評価につながる要因、リターンの持続可能性を分析します。</p> <p>企業の政治的リスク、マクロ経済面のリスク、コーポレート・ガバナンスに関するリスク、ポートフォリオ全体でのリスクを評価し、国やセクター別の配分をモニターします。</p> <p>市場動向や資金動向等によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の配当収益および売買益の範囲内とします。</p> <p>原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし分配対象額が小額の場合には、分配を行わないことがあります。</p>
信託期間	無期限(平成19年3月23日当初設定)
決算日	毎年3月31日
管理報酬等	<p>信託財産の純資産総額に下記の率(年率)を乗じた額</p> <p>運用報酬等:1.00%</p> <p>事務代行費用等:最大0.30%</p> <p>その他外国投資法人に関する租税、設立費用・登録料、有価証券の売買や先物取引の際に発生する費用等が支払われます。</p>

ファンドの 関係法人	管理会社:ラザード・ファンド・マネジャーズ(アイルランド)・リミテッド 運用会社:ラザード・アセット・マネージメント・エルエルシー 管理事務代行会社:BNYMロン・インベストメント・サービシング(インターナショナル)・リミテッド
ベンチマーク	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(税引後配当込み)
ベンチマークにつ いて	MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

17. ペアリング外国債券ファンドM (F0Fs用) (適格機関投資家専用)

形態	追加型証券投資信託
運用の基本方針	中長期的な観点から、シティ世界国債インデックス(除く日本・円ベース)を上回る投資成果の獲得を目指して運用を行います。
主要投資対象	BAM外国債券マザーファンド受益証券
投資態度	主として、BAM外国債券マザーファンド受益証券に投資を行ない、シティ世界国債インデックス(除く日本・円ベース)を上回る投資成果を挙げることを目指します。 BAM外国債券マザーファンド受益証券の組入率は、高位を保つことを原則とします。 ただし、資金動向等によっては組入率を引き下げることがあります。 ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったとき等やむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。 為替変動リスクに関しては、外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則行いません。
マザーファンドの 投資態度	信用度の高い世界各国の公社債を中心に投資を行ない、安定したインカム(利子等収益)の確保と中長期的な信託財産の成長を目指します。 ポートフォリオの構築にあたっては、信用度の調査、各国の金利動向の見通しに基づき、安定したリターンの獲得とリスクコントロールにつとめます。 為替変動リスクに関しては、外貨建資産について円に対する為替ヘッジは原則行いません。
主な投資制限	株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものの新株予約権に限ります。)の行使等により取得した株券に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。
信託期間	無期限(平成18年11月29日当初設定)
決算日	毎月5日(第1計算期間は信託契約締結日より平成19年1月5日まで)(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.3675%(税抜0.35%)の率を乗じて得た額とします。他に信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託者の立替えた立替金の利息が、信託財産から支払われます。 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率0.378%となります。
ファンドの 関係法人	委託会社:ペアリング投信投資顧問株式会社 受託会社:三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	シティ世界国債インデックス(除く日本・円ベース)
ベンチマーク について	「シティ世界国債インデックス」とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した世界主要国の国債の総合投資利回り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す。シティ世界国債インデックス(除く日本・円ベース)は、シティ世界国債インデックス(除く日本)・データに基づき日興シティグループ証券株式会社の承諾を得たうえでペアリング投信投資顧問株式会社が計算したものです。「シティ世界国債インデックス」に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。

18. ブラックロック外国債券ファンドM (F0Fs用) (適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
----	-----------

運用の基本方針	中長期的に投資信託財産の成長を目指した運用を行ないます。								
主要投資対象	BR外国債券マザーファンド受益証券								
投資態度	<p>主としてBR外国債券マザーファンド受益証券への投資を通じて世界主要国の国債等(国債、政府機関債、国際機関債)を中心に公社債に投資します。 シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目指します。 デュレーション・リスク、イールドカーブ・リスク、セクター・リスク等の調整にあたっては、債券先物取引等のデリバティブを活用することがあります。 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないませんが、一部機動的な運用を行なう場合もあります。 ブラックロック・グループの運用会社に、以下の運用の指図に関する権限を委託します。</p> <table border="1" data-bbox="395 488 1362 1081"> <thead> <tr> <th data-bbox="395 488 842 526">商号</th> <th data-bbox="847 488 1362 526">委託する権限</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="395 533 842 734">ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク (BlackRock Financial Management, Inc.)</td> <td data-bbox="847 533 1362 734"> <ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 ・信託財産にかかる地域配分等の包括的な投資判断を行なう権限(当該権限は委託会社と共有するものとします。) </td> </tr> <tr> <td data-bbox="395 741 842 943">ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド(BlackRock Investment Management (UK) Limited)</td> <td data-bbox="847 741 1362 943"> <ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 ・信託財産にかかる地域配分等の包括的な投資判断を行なう権限(当該権限は委託会社と共有するものとします。) </td> </tr> <tr> <td data-bbox="395 949 842 1081">ブラックロック・インベストメント・マネジメント(オーストラリア)リミテッド(BlackRock Investment Management (Australia) Limited)</td> <td data-bbox="847 949 1362 1081"> <ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 </td> </tr> </tbody> </table> <p>前記に関わらず、委託会社は、日本を除く市場の休場日に投資環境の変化等が認められた場合等に必要に応じて、外国債券等の運用ならび当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図を自ら行なうことができます。 資金動向、市場動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用が出来ない場合もあります。</p>	商号	委託する権限	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク (BlackRock Financial Management, Inc.)	<ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 ・信託財産にかかる地域配分等の包括的な投資判断を行なう権限(当該権限は委託会社と共有するものとします。) 	ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド(BlackRock Investment Management (UK) Limited)	<ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 ・信託財産にかかる地域配分等の包括的な投資判断を行なう権限(当該権限は委託会社と共有するものとします。) 	ブラックロック・インベストメント・マネジメント(オーストラリア)リミテッド(BlackRock Investment Management (Australia) Limited)	<ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限
商号	委託する権限								
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク (BlackRock Financial Management, Inc.)	<ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 ・信託財産にかかる地域配分等の包括的な投資判断を行なう権限(当該権限は委託会社と共有するものとします。) 								
ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド(BlackRock Investment Management (UK) Limited)	<ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 ・信託財産にかかる地域配分等の包括的な投資判断を行なう権限(当該権限は委託会社と共有するものとします。) 								
ブラックロック・インベストメント・マネジメント(オーストラリア)リミテッド(BlackRock Investment Management (Australia) Limited)	<ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 								

マザーファンドの投資態度	<p>主として、世界主要国の国債等(国債、政府機関債、国際機関債)を中心に公社債に投資します。</p> <p>シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、これを上回る投資成果を目指します。</p> <p>デュレーション・リスク、イールドカーブ・リスク、セクター・リスク等の調整にあたっては、債券先物取引等のデリバティブを活用することがあります。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないませんが、一部機動的な運用を行なう場合もあります。</p> <p>ブラックロック・グループの運用会社に、以下の運用の指図に関する権限を委託します。</p> <table border="1" data-bbox="408 398 1361 992"> <thead> <tr> <th data-bbox="408 398 842 443">商号</th> <th data-bbox="842 398 1361 443">委託する権限</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="408 443 842 645">ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク (BlackRock Financial Management, Inc.)</td> <td data-bbox="842 443 1361 645"> <ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 ・信託財産にかかる地域配分等の包括的な投資判断を行なう権限(当該権限は委託会社と共有するものとします。) </td> </tr> <tr> <td data-bbox="408 645 842 846">ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド(BlackRock Investment Management (UK) Limited)</td> <td data-bbox="842 645 1361 846"> <ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 ・信託財産にかかる地域配分等の包括的な投資判断を行なう権限(当該権限は委託会社と共有するものとします。) </td> </tr> <tr> <td data-bbox="408 846 842 992">ブラックロック・インベストメント・マネジメント(オーストラリア)リミテッド(BlackRock Investment Management (Australia) Limited)</td> <td data-bbox="842 846 1361 992"> <ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 </td> </tr> </tbody> </table> <p>前記に関わらず、委託会社は、日本を除く市場の休日に投資環境の変化等が認められた場合等に必要に応じて、外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図を自ら行なうことができます。</p> <p>資金動向、市場動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用が出来ない場合もあります。</p>	商号	委託する権限	ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク (BlackRock Financial Management, Inc.)	<ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 ・信託財産にかかる地域配分等の包括的な投資判断を行なう権限(当該権限は委託会社と共有するものとします。) 	ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド(BlackRock Investment Management (UK) Limited)	<ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 ・信託財産にかかる地域配分等の包括的な投資判断を行なう権限(当該権限は委託会社と共有するものとします。) 	ブラックロック・インベストメント・マネジメント(オーストラリア)リミテッド(BlackRock Investment Management (Australia) Limited)	<ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限
商号	委託する権限								
ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク (BlackRock Financial Management, Inc.)	<ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 ・信託財産にかかる地域配分等の包括的な投資判断を行なう権限(当該権限は委託会社と共有するものとします。) 								
ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド(BlackRock Investment Management (UK) Limited)	<ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 ・信託財産にかかる地域配分等の包括的な投資判断を行なう権限(当該権限は委託会社と共有するものとします。) 								
ブラックロック・インベストメント・マネジメント(オーストラリア)リミテッド(BlackRock Investment Management (Australia) Limited)	<ul style="list-style-type: none"> ・外国債券等の運用ならびに当該運用に付随する為替売買および為替ヘッジの指図に関する権限 								
主な投資制限	<p>株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券(親投資信託の受益証券を除きます。)への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p>								
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等とします。</p> <p>分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。</p>								
信託期間	無期限(平成21年9月10日設定)								
決算日	毎月5日(休業日の場合翌営業日)								
管理報酬等	<p>信託報酬の総額は、投資信託財産の純資産総額に年0.42%(税抜年0.40%)の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、海外保管報酬等が投資信託財産から支払われます。</p> <p>消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率0.432%となります。</p>								
ファンドの関係法人	<p>委託会社:ブラックロック・ジャパン株式会社</p> <p>受託会社:三菱UFJ信託銀行株式会社</p> <p>投資顧問会社:ブラックロック・ファイナンシャル・マネジメント・インク(BlackRock Financial Management, Inc.)、ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド(BlackRock Investment Management (UK) Limited)、ブラックロック・インベストメント・マネジメント(オーストラリア)リミテッド(BlackRock Investment Management (Australia) Limited)</p>								
ベンチマーク	シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)								
ベンチマークについて	<p>シティ世界国債インデックスとは、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが公表する、世界主要国の国債の総合投資利回りを指数化したものです。シティ世界国債インデックスに関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケッツ・インクに帰属します。</p>								

19. LM・ブランディワイン外国債券ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	当ファンドは、主に「LM・ブランディワイン外国債券マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に日本を除く世界の公社債に実質的に投資を行うことにより、信託財産の中長期的成長を目指します。
主要投資対象	LM・ブランディワイン外国債券マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券
投資態度	LM・ブランディワイン外国債券マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の中長期的な成長を目指します。 LM・ブランディワイン外国債券マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。 資金動向、市場動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
マザーファンドの投資態度	主に、日本を除く世界の公社債に投資します。 外貨建資産の為替ヘッジは、原則として行いません。ただし、通貨見通しに基づいて相対的に魅力があると判断される通貨に、為替予約取引等を通じて資産配分することがあります。 取得時において、原則として1社以上の格付機関から投資適格(BBB-/Baa3以上)の長期格付けが付与された、あるいはこれに相当する信用力をもつと運用者が判断する公社債に投資します。 運用の指図に関する権限をブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシーに委託します。
主な投資制限	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。 新株引受権証券及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。 投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)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。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。 為替予約の利用及びデリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。
収益の分配	分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の配当等収益(マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額を含みます。)及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 収益分配金額は、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。ただし、分配対象額が少額等の場合は、分配を行わない場合があります。
信託期間	無期限(平成26年3月10日当初設定)
決算日	毎年3月15日(休業日の場合翌営業日)(第1計算期間は平成27年3月16日まで)
管理報酬等	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年率0.3990%(税抜0.38%)の率を乗じて得た額とします。他に組入有価証券売買時の売買委託手数料等、その他諸費用(監査費用、印刷等費用、受益権の管理事務費用等。純資産総額の年率0.05%を合計上限額とします。)が信託財産から支払われます。 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率0.4104%となります。
ファンドの関係法人	委託会社: レッグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社 受託会社: 三菱UFJ信託銀行株式会社 マザーファンドの投資顧問会社: ブランディワイン・グローバル・インベストメント・マネジメント・エルエルシー
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマークについて	該当事項はありません。

20. ウェリントン・マネージメント・ポートフォリオ(ケイマン)

グローバル総合債券(除く日本)ポートフォリオ クラスB 受益証券(適格機関投資家限定)

形態	ケイマン籍信託型外国投資信託(受託会社と管理会社との間の信託証書に基づく)/円建て
運用の基本方針	ポートフォリオは、グローバル債券(日本を除く)への分散投資を通じ、パークレイズ・グローバル総合債券指数(除く日本)を上回る長期的な総合収益の確保を目指して運用されます。
主要投資対象	ポートフォリオは、世界の発行体の発行する、市場性の高い債券に主に投資します。

投資態度	<p>ポートフォリオは、ベンチマーク指数に含まれる債券に投資します。指数に含まれない政府、政府関連機関、国際機関の発行する債券、モーゲージ担保証券、社債、アセットバック証券、インフレ連動債券、地方債、トラスト優先証券、その他の債券に投資することがあります。</p> <p>投資対象債券は、指数に含まれる国の通貨建て、もしくはスタンダード・アンド・プアーズ社またはムーディーズ社の格付けがBBB-/Baa3以上の指数に含まれない国の通貨(「対象通貨」)建てとします。</p> <p>現金並びに現金同等物は、投資戦略の遂行の目的で、またはデリバティブ投資の担保として保有することがあります。</p> <p>現金並びに現金同等物を除いては、円建て債券は組み入れません。</p> <p>市場エクスポージャーを得るため、もしくはヘッジを目的として、債券・為替先渡し;債券・為替オプション;金利・債券トータルリターン・クレジットデフォルト・通貨スワップ取引;上場債券・上場為替先物の取引を行うことがあります。ポートフォリオの保有債券・通貨ポジションとは関連しない単独の売建ポジションを取ることもありますが、経済的レバレッジは取りません。</p> <p>運用会社がその流動性について適切であると認めた場合、私募証券、その他の規制証券に投資を行うことがあります。</p> <p>運用会社が適切であると認めた場合、運用会社またはその関連会社が運用する他の投資ファンドの持分に投資を行う場合があります。ただし、運用手数料の重複が無い場合に限りです。</p> <p>ポートフォリオは通常、グローバル債券市場の国、通貨、セクター、発行体に広く分散投資します。</p> <p>ポートフォリオは円建てとし、ヘッジ無しクラス受益証券については、通常ヘッジなしとします。ただし、アクティブな通貨戦略に基づき、機を見て選別的に通貨エクスポージャーをヘッジすることがあります。同様に、ヘッジ有リクラス受益証券において、アクティブな通貨ポジションを除いたポートフォリオの通貨ポジションは通常円ヘッジされます。ヘッジ有リクラス受益証券のヘッジに関わる証券ならびに投資商品は、当該受益証券特有のものとし、当該ヘッジ取引から生じる実現/評価損益及び費用は、各々のヘッジ有リクラス受益証券に配分されます。</p> <p>ポートフォリオは、ポートフォリオの債券ポジションに関わりなく、対象通貨の売り・買いポジションをアクティブに取ることがあります。</p> <p>運用方針の重要な変更は、全ての受益者への事前通知の後、受託会社の同意を得た上で行われる場合があります。受託会社は、当該変更についての受益者からの同意を求めることがあります。</p>
主な投資制限	<p>同一銘柄への投資は、組み入れ時のポートフォリオ資産の5%以内とします。ただし、1)OECD諸国、政府関連機関、それらの下部組織、または国際・地域機関や機構が発行・保証する証券、2)デリバティブ取引のカウンターパーティ、3)投資対象に含まれる投資ファンドについてはこの制限を課しません。</p> <p>資金の借り入れは、短期的な資金繰り、特殊なかつ緊急の目的以外には行いません。投資レバレッジを目的とした借り入れは行いません。</p> <p>ポートフォリオ全体のデュレーションは穏やかで、典型的にはベンチマーク指数の75%から125%の範囲内となります。個別銘柄におけるデュレーションの範囲はこれよりも大きくなる場合があります。</p> <p>債券デリバティブのエクスポージャーは、ネットではポートフォリオ時価総額の100%、グロスでは200%を超えないこととします。</p> <p>米ドル、ユーロ、英ポンドの通貨エクスポージャーは、通常、ベンチマーク指数における配分の±20%以内、日本円およびその他の対象通貨はベンチマーク指数における配分の±10%以内となることが想定されます。</p> <p>ポートフォリオの加重平均格付けはA-/A3以上となることが想定されます。投資適格未満(スタンダード・アンド・プアーズ社またはムーディーズ社の格付けがBBB-/Baa3未満)の債券、または無格付けの場合で運用会社がそれと同等の信用力であると見なす債券の組み入れは、ポートフォリオ資産の10%以内とします。</p> <p>有価証券(現物に限る)の空売りについて、空売りを行った有価証券の時価総額がポートフォリオ純資産総額を超えないものとします。</p> <p>資金の借り入れは、合併等による一時的な場合を除き、ポートフォリオ純資産総額の10%以下とします。</p> <p>流動性の低い資産への投資は、ポートフォリオ純資産総額の15%以下とします。</p> <p>他の投資信託証券への投資(REIT、ETFを含む)は、ポートフォリオ純資産総額の5%以下とします。</p>
収益の分配	<p>運用会社の裁量により、各クラス受益証券の持分のポートフォリオ資産から得られたネットインカムとネットキャピタルゲイン(実現益および未実現益)の一部または全部を分配金として払い出す予定です。</p> <p>分配金額は原則として委託者が基準価額水準等を勘案して決定します。基準価額によっては分配を行わないことがあります。</p>

信託期間	信託証書の日付(2005年1月12日)から150年間。ただし一定の事由の場合、終了することがあります。
決算日	毎年12月31日
管理報酬等	運用報酬0.50%(年率)、その他に管理費用がかかります。 管理費用には0.15%(年率)の上限を設けていますが、運用会社の裁量により変更される場合もあります。
ファンドの 関係法人	(運用会社)ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー (受託会社)ステート・ストリート・ケイマン・トラスト・カンパニー・リミテッド (カストディアン)ステート・ストリート・バンク・アンド・トラスト・カンパニー (監査法人)プライスウォーターハウスクーパース
ベンチマーク	パークレイズ・グローバル総合債券指数(除く日本)
ベンチマーク について	パークレイズ・グローバル総合債券指数(除く日本)は、パークレイズ・バンク・ピーエルシーおよび 関連会社(パークレイズ)が開発、算出、公表を行う指数であり、日本を除く世界の投資適格債券市場 のパフォーマンスを示す代表的な指数です。当該指数に関する知的財産権およびその他の一切の 権利はパークレイズに帰属します。

21. T.ロウ・プライス新興国債券オープンM(FOFs用)(適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	主として新興国の政府および政府機関等の発行する米ドル建ての債券を中心に実質的に投資を 行うことにより、安定的かつ高水準のインカム収益の確保と信託財産の長期的な成長をめざして運 用を行います。
主要投資対象	新興国債券マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券
投資態度	新興国債券マザーファンドを通じて、主として新興国の政府および政府機関等の発行する米ド ル建ての債券を中心に投資します。(米ドル建て以外の資産に投資する場合があります。) JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイド(円 換算)をベンチマークとします。 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 資金動向、市況動向等によっては、あるいはやむを得ない事情が発生した場合には上記のよ うな運用ができない場合があります。 当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。
マザーファンドの 投資態度	主として新興国の政府および政府機関等の発行する米ドル建ての債券を中心に投資します。 (米ドル建て以外の資産に投資する場合があります。) JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイド(円 換算)をベンチマークとします。 組入れ外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 運用の指図に関する権限をT.ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドに委託します。 資金動向、市況動向、残存信託期間、残存元本等によっては、上記のような運用ができない場 合があります。
主な投資制限	マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。 株式への実質投資割合は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予 約権行使により取得したものに限り、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内としま す。 同一銘柄の株式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5%以内と します。 投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)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。 外貨建資産への実質投資には制限を設けません。 デリバティブの活用はヘッジ目的に限定しません。
収益の分配	分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益(評価損益も含まれます。) 等の範囲内とします。 安定した分配を継続的に行うことを目指します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を 行わないことがあります。
信託期間	無期限(平成19年8月10日当初設定)
決算日	毎月5日(第1計算期間は平成19年9月5日まで)(休業日の場合翌営業日)

管理報酬等	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.6195% (税抜0.59%)の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率0.6372%となります。
ファンドの 関係法人	委託会社:大和住銀投信投資顧問株式会社 受託会社:三井住友信託銀行株式会社 (マザーファンドの投資顧問会社:T・ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッド)
ベンチマーク	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイド(円換算)
ベンチマーク について	JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイド(JPモルガンEMBIグローバル・ダイバーシファイド)とは、JPモルガン社が公表する債券指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権およびその他一切の権利はJPモルガン社に帰属します。JPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイド(円換算)とは、米ドルベースのJPモルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・グローバル・ダイバーシファイドを大和住銀投信投資顧問株式会社が円換算したものです。

22. ダイワ米ドル建て新興国債券ファンドM (F0Fs用) (適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	新興国債券マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券
投資態度	<p>主として、マザーファンドの受益証券を通じて、新興国の国家機関が発行する米ドル建ての債券に投資し、新興国の債券市場の中長期的な値動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>新興国の国家機関が発行する米ドル建て以外の債券、米国の国家機関および国際機関が発行する債券にも投資する場合があります。米ドル建て以外の債券に投資する場合、原則として、為替予約取引および直物為替先渡取引等を活用し、実質的に米ドル建てとなるように為替取引を行ないます。</p> <p>マザーファンドにおいて、運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、マザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p> <p>当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。</p>
マザーファンドの投資態度	<p>主として、新興国の国家機関が発行する米ドル建ての債券に投資し、新興国の債券市場の中長期的な値動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>新興国の国家機関が発行する米ドル建て以外の債券、米国の国家機関および国際機関が発行する債券にも投資する場合があります。米ドル建て以外の債券に投資する場合、原則として、為替予約取引および直物為替先渡取引等を活用し、実質的に米ドル建てとなるように為替取引を行ないます。</p> <p>運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(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。)の行使等により取得したものに限りません。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券(マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p>

収益の分配	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。 原則として、継続的な分配を行なうことを目標に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
信託期間	無期限(平成26年2月10日当初設定)
決算日	毎月8日(第1計算期間は平成26年3月8日まで)(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.315%(税抜0.3%)の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年0.324%となります。
ファンドの 関係法人	委託会社:大和証券投資信託委託株式会社 受託会社:三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマーク について	該当事項はありません。

23. ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンド

形態	証券投資信託 / 親投資信託
運用の基本方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所()上場(上場予定を含みます。以下同じ。)の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券(以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。) 金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。
投資態度	わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。 投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。 イ. 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。 ロ. 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。 不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	株式への直接投資は、行ないません。 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 外貨建資産への直接投資は、行ないません。
収益の分配	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
信託期間	無期限(平成17年11月14日当初設定)
決算日	毎年5月10日および11月10日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。
ファンドの 関係法人	委託会社:大和証券投資信託委託株式会社 受託会社:三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマーク について	該当事項はありません。

24. ダイワ海外 R E I T・マザーファンド

形態	証券投資信託 / 親投資信託
----	----------------

運用の基本方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	海外の金融商品取引所()上場(上場予定を含みます。以下同じ。)および店頭登録(登録予定を含みます。以下同じ。)の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券(以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。) 金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。
投資態度	主として海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券に投資し、信託財産の中長期的な成長と配当等収益の確保をめざして分散投資を行ないます。 投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。 イ. S & P先進国REIT指数(除く日本、円換算)をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざします。 ロ. 個別銘柄ごとに、相対的な割安度、期待される成長性、配当利回りなどを勘案しポートフォリオを構築します。 外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。 不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。 外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	株式への直接投資は、行ないません。 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。 同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
収益の分配	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
信託期間	無期限(平成18年11月28日当初設定)
決算日	毎年3月15日および9月15日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。
ファンドの関係法人	委託会社: 大和証券投資信託委託株式会社 受託会社: 三井住友信託銀行株式会社 投資顧問会社: コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク (運用指図権限の委託) 委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次のものに委託します。 コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク New York, New York, USA 前 の規定にかかわらず、前 により委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。
ベンチマーク	S & P先進国REIT指数(除く日本、円換算)
ベンチマークについて	S & P先進国REIT指数(除く日本、円換算)の所有権およびその他一切の権利は、スタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シーが有しています。スタンダード&プアーズは、同指数の算出にかかる誤謬等に関し、いかなる者に対しても責任を負うものではありません。

25. ダイワ・マネー・マザーファンド

形態	証券投資信託 / 親投資信託
運用の基本方針	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	本邦通貨表示の公社債

投資態度	わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。 邦貨建資産の組入れにあたっては、取得時に第二位(A-2格相当)以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、コマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。))の新株予約権に限ります。) 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 投資信託証券への投資は、行ないません。 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%以下とします。 外貨建資産への投資は、行ないません。
収益の分配	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
信託期間	無期限(平成16年12月10日当初設定)
決算日	毎年12月9日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。
ファンドの 関係法人	委託会社:大和証券投資信託委託株式会社 受託会社:三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマーク について	該当事項はありません。

26. Daiwa " RICI " Fund (ダイワ " RICI " ファンド)

形態 / 表示通貨	ケイマン籍の外国証券投資信託 / 米ドル建て
運用目的	投資成果がロジャーズ国際コモディティ指数(" RICI ")に連動することをめざします。
投資方針	信託財産の純資産総額の50%以上を米ドル建て公社債等に投資するとともに、世界の商品先物取引および商品先渡取引等に投資することで、ロジャーズ国際コモディティ指数(" RICI ")に連動する投資成果をめざします。 米ドル建て短期公社債等への投資にあたっては、主に1年以内に償還を迎える米ドル建て短期公社債等に投資します。また、投資対象には、銀行引受手形、預託証書、コマーシャル・ペーパー、定期預金証書などへの投資も含まれますが、これに限定いたしません。 信託財産の純資産総額の50%未満の部分で商品先物取引および商品先渡取引に投資します。 当ファンドの純資産に占める、商品先物取引および商品先渡取引等の証拠金の割合はおおよそ10 - 30パーセントの範囲で行ないます。(また、最大でも、純資産の50%以下とします。) 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用が行なわれない場合があります。 当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。
設定日	平成18年11月13日
決算日	毎年4月30日
管理報酬等	信託財産の純資産総額に下記の率(年率)を乗じた額 管理報酬等:0.415%(管理会社代行サービス報酬を含みます。) 受託報酬等:0.175%(管理事務代行報酬および資産保管会社の報酬を含みます。) 運用報酬等:0.41% 合計:1.00% その他、外国投資信託に関する租税、設立費用・登録料、監査費用、有価証券の売買や先物取引の際に発生する費用等が支払われます。

ファンドの 関係法人	管理会社:ダイワ・アセット・マネジメント・サービスズ・リミテッド(ケイマン) 受託会社:G.A.S.(ケイマン)リミテッド 運用会社:ダイワ・アセット・マネジメント(シンガポール)リミテッド 資産保管会社:SMT Trustees (Ireland) Limited 管理事務代行会社:SMT Fund Services (Ireland) Limited 管理会社代行サービス会社:大和証券投資信託委託株式会社
ロジャーズ国際 コモディティ指数 (" RICI ")とは	<ul style="list-style-type: none"> ・RICIは、世界中の経済活動に広く利用されているコモディティ(商品)の値動きを表わします。 ・RICIは、37種類(平成25年12月現在)の商品先物で構成される指数です。 ・RICIは、平成10年8月より計算および公表を行なっております。 ・RICIを構成する品目とその比率は、ジム・ロジャーズ氏が議長をつとめるRICI委員会において、各品目の需要見通しおよび先物市場の流動性等を勘案して決定されます。 ・RICIは、投資可能性を考慮に入れた実用性の高い指数です。

27. ダイワ・トピックス・ニュートラル (F0Fs用) (適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	マーケットの状況にかかわらず、安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	ダイワ・バリュエーション・トピックス・マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券および株価指数先物取引
投資態度	<p>「マーケット・ニュートラル戦略」を採用することにより、マーケットの状況にかかわらず、安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。</p> <p>当ファンドにおける「マーケット・ニュートラル戦略」とは次のとおりです。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 現物株式のポートフォリオが有するTOPIX(東証株価指数)の動きに依存して変動する要素(以下「マーケット・リスク」といいます。)を株価指数先物取引の売建てを利用して可能な限りヘッジし、TOPIXの動きの影響を受けにくい投資成果の獲得をめざします。 株式と株価指数先物の価格変動の差異その他の事情により、マーケット・リスクが完全にヘッジできないことがあります。その他、値幅制限やサーキットブレーカー制度など株価指数先物取引における取引を規制する制度が適用されたあるいは適用される可能性が高まった場合には、その差異が顕著になることが想定されます。また、そうした場合には、株価指数先物取引の流動性が低下していることがあり、必要な建玉数量の調整ができなくなる場合があります。 2. マザーファンドの受益証券への投資は、通常の状態では信託財産の純資産総額に対して70%程度から80%程度を基本とします。当該比率は、株価指数先物取引の証拠金にも依存し、当該証拠金の額もしくは率に変更された場合には、当該比率も変更となることがあります。 3. 株価指数先物取引は、TOPIX先物取引を利用することを原則としますが流動性その他を考慮して他の株価指数先物取引等を利用することがあります。 株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資は、原則として、信託財産総額の50%以下とします。 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。 当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。

マザーファンドの投資態度	<p>株式の運用にあたっては、東証株価指数(TOPIX)をベンチマークとし、ベンチマークの変動性に対する基準価額の変動性の乖離(「トラッキング・エラー」といいます。)が大きくなるよう努めつつ、ベンチマークを上回る投資成果が得られるようポートフォリオ管理を行ない、信託財産の成長をめざします。</p> <p>株式ポートフォリオの構築にあたっては、「大和ストック・バリュエーション・モデル」を用いた定量評価を基本とし、これに運用担当者の投資判断を加えて行ないます。</p> <p>1. 当該モデルの概略は次のとおりです。</p> <p>イ. 企業の財務諸表、利益予想データに基づく指標等から計量的に理論株価を推定します。</p> <p>ロ. 理論株価と実際の株価との比較により個別銘柄の相対的な投資魅力度を算出します。</p> <p>ハ. 投資魅力度から個別銘柄の期待収益率を算出します。</p> <p>将来、モデルを改良のため変更することがあります。将来、上記をめざす手段を、当該モデルの利用以外のものに変更することがあります。</p> <p>2. 運用担当者は、上記の目的のため、当該モデルの適用結果に対して銘柄の追加、削除を行なうほか、個別銘柄の流動性の欠如、突発的な事象の発生などの存在を精査し、投資判断を行ないます。</p> <p>株式への投資比率は、通常の状態でも可能な限り高位に維持することを基本とします。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行ないません。</p>
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。</p> <p>原則として、配当等収益等を中心に分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。</p>
信託期間	無期限(平成19年11月8日当初設定)
決算日	毎年2月25日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	<p>信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.4305% (税抜0.41%)の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。</p> <p>消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率0.4428%となります。</p>
ファンドの関係法人	<p>委託会社: 大和証券投資信託委託株式会社</p> <p>受託会社: 三井住友信託銀行株式会社</p>
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマークについて	該当事項はありません。

28. 大和住銀FoF用ジャパン・マーケット・ニュートラル(適格機関投資家限定)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の株式へ投資するとともに、株価指数先物取引等の派生商品取引を活用し、株式市場の変動リスクの低減を図りつつ、安定的な収益の獲得を目指して運用を行います。
主要投資対象	大和住銀ジャパン・スペシャル・マザーファンドへの投資を通じて、わが国の株式を主要投資対象とします。また、株式市場の変動リスクの低減を図ることを目的として、株価指数先物取引等の派生商品取引を活用します。

投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、わが国の株式を主要投資対象とし、銘柄調査を重視したアクティブ運用を行います。</p> <p>運用にあたっては、ボトムアップ・アプローチにより、「ファンダメンタル価値対比割安なバリュー銘柄」と「将来収益への成長期待が高いグロース銘柄」を中心に投資します。現物株式(マザーファンドの信託財産に属する株式のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含む。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以上とします。株式以外への資産(マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含む。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>実質株式組入について、株式市場の変動リスクの低減を図ることを目的として、株価指数先物取引等の派生商品取引を活用します。</p> <p>資金動向、市況動向、残存期間等およびやむを得ない事情が発生した場合は上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引及び金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引及び金利にかかるオプション取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。</p>
マザーファンドの投資態度	<p>わが国の株式を主要投資対象とし、銘柄調査を重視したアクティブ運用を行います。</p> <p>運用にあたっては、ボトムアップ・アプローチにより、「ファンダメンタル価値対比割安なバリュー銘柄」と「将来収益への成長期待が高いグロース銘柄」を中心に投資します。株式への投資は、原則として信託財産総額の50%以上とします。株式以外への資産への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>TOPIX(東証株価指数)をベンチマークとし、ベンチマークに対するリスクコントロールを重視しつつ、ベンチマークを安定的に上回る投資成果を目指します。</p> <p>資金動向、市況動向、残存期間等およびやむを得ない事情が発生した場合は上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引及び金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引及び金利にかかるオプション取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への実質投資は行いません。</p> <p>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。</p> <p>投資信託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。ただし、親投資信託への投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の株式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10%以内とします。</p> <p>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、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p>
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として次の方針に基づき分配を行います。</p> <p>分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益(評価損益も含まれます。)等の範囲内とします。</p> <p>収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。</p>
信託期間	無期限
決算日	毎年10月15日(休業日の場合翌営業日)

管理報酬等	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.5355%（税抜0.51%）の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われ ます。 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率0.5508%となります。
ファンドの 関係法人	委託会社：大和住銀投信投資顧問株式会社 受託会社：三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマーク について	該当事項はありません。

29. T & D米国金利戦略ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	市場動向にかかわらず安定した収益の獲得をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	短期金利戦略マザーファンドとイールドカーブ戦略マザーファンドを主な投資対象としま す。
投資態度	短期金利戦略マザーファンドを通じて、実質的に米国の短期金利先物による戦略（以 下、「短期金利先物戦略インデックス」といいます。）を構築します。 イールドカーブ戦略マザーファンドを通じて、実質的に米国金利（1年以上）による戦 略（以下、「イールドカーブ戦略インデックス」といいます。）を構築します。 短期金利戦略マザーファンド及びイールドカーブ戦略マザーファンドを合計した純資産 総額に対する時価構成比率合計は、100%を上限として原則として高位を保つものとし ます。 短期金利戦略マザーファンド及びイールドカーブ戦略マザーファンドの各々の純資産総 額に対する時価構成比率は、経済動向などを勘案して、それぞれ委託会社が決定しま す。 各マザーファンドにおいては、原則として有価証券店頭指数等先渡取引を利用して各戦 略の投資効果を受けます。 大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還 の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれな いことがあります。
マザーファンドの 投資態度	<短期金利戦略マザーファンド> 店頭デリバティブ取引をヘッジ目的以外に積極的に利用し、原則として有価証券店頭指数等先 渡取引の買建を通じて、実質的に短期金利先物戦略インデックスのパフォーマンスに連動する 投資成果を獲得することで、市場動向にかかわらず安定した収益の獲得をめざして運用を行な います。 わが国の国債の組み入れは純資産総額の50%以上とします。 有価証券店頭指数等先渡取引のネット買建額の信託財産の純資産総額に対する割合は、原則 として高位を保ちます。 有価証券店頭指数等先渡取引の相手方との間で、原則として現金による担保の差入若しくは受 入を行います。 ファンドの設定解約動向その他の資金動向、市場動向等により、若しくは当初設定時、償還時、 決算時等においては、上記のような運用が行われない場合があります。 <イールドカーブ戦略マザーファンド> 店頭デリバティブ取引をヘッジ目的以外に積極的に利用し、原則として有価証券店頭指数等先 渡取引の買建を通じて、実質的にイールドカーブ戦略インデックスのパフォーマンスに連動する 投資成果を獲得することで、市場動向にかかわらず安定した収益の獲得をめざして運用を行な います。 わが国の国債の組み入れは純資産総額の50%以上とします。 有価証券店頭指数等先渡取引のネット買建額の信託財産の純資産総額に対する割合は、原則 として高位を保ちます。 有価証券店頭指数等先渡取引の相手方との間で、原則として現金による担保の差入若しくは受 入を行います。 ファンドの設定解約動向その他の資金動向、市場動向等により、若しくは当初設定時、償還時、 決算時等においては、上記のような運用が行われない場合があります。

主な投資制限	マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。 株式(投資信託証券の性質を有するものを除きます。)への投資は、転換社債の転換または新株予約権の行使により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への直接投資は行いません。 デリバティブ取引の利用は、ヘッジ目的に限定しません。
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
信託期間	無制限(平成26年3月6日当初設定)
決算日	毎年4月25日(休業日の場合翌営業日)(第1計算期間は平成27年4月27日まで)
管理報酬等	信託報酬の総額は、投資信託財産の純資産総額に年率0.357%(税抜0.34%)の率を乗じて得た額とします。他に監査報酬、有価証券売買時の売買委託手数料等が投資信託財産から支払われます。 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率0.3672%となります。
ファンドの関係法人	委託会社:T & Dアセットマネジメント株式会社 受託会社:三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマークについて	該当事項はありません。

30. シンプレクス・イベントドリブン・ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	日本の株式のうち、主に親子上場 ¹ の子会社等 ² の株式を主要投資対象とします。
投資態度	主に、日本の株式のうち、主に親子上場 ¹ の子会社等 ² の株式のなかから、ボトムアップ・アプローチによる企業調査情報などにに基づき銘柄を選定し、ポートフォリオを構築します。 信用取引による売建てを行なうことがあります。 先物取引による売建てを行なうことがあります。 株式の組入比率は原則として、信託財産の50%超を基本とします。 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の50%以下を基本とします。 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。 当ファンドは、原則としてファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。 1 親子上場とは、親会社等 ³ と子会社等が共に上場していることをいいます。 2 子会社等とは、法人がその総株主数等の議決権の15%以上を保有する会社をいいます。 3 親会社等とは、 ² の子会社等の株式を保有する会社をいいます。
主な投資制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資は行ないません。 デリバティブ取引の利用は、ヘッジ目的に限定しません。 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。 信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額が、取得時において信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とします。 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。
信託期間	無期限(平成26年3月10日当初設定)

決算日	毎年3月20日および9月20日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	信託報酬の総額は、投資信託財産の純資産総額に年率1.3125%（税抜1.25%）の率を乗じて得た額とします。他に組入有価証券や派生商品等の売買の際に発生する売買委託手数料、受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、随時、信託財産中から支弁します。信託の計理およびこれに付随する業務や法定書類の作成・交付に要する費用等(これらの業務を外部に委託する場合も含まれます。)、また、信託の監査人および法律顧問等に対する報酬や費用等も信託財産中から支弁されます。 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、年率1.35%となります。
ファンドの関係法人	委託会社: シンプレクス・アセット・マネジメント株式会社 受託会社: 三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマークについて	該当事項はありません。

【指定投資信託証券の委託会社等について】

指定投資信託証券の委託会社等の沿革は、以下のとおりです。

大和証券投資信託委託株式会社

昭和34年12月12日	設立登記
昭和35年2月17日	「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
昭和35年4月1日	営業開始
昭和60年11月8日	投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
平成7年5月31日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
平成7年9月14日	「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
平成19年9月30日	「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。

JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社

昭和46年	ジャーディン・フレミング、日本市場の成長性に着目し東京に駐在員事務所を開設
昭和60年	ジャーディン・フレミング投資顧問株式会社設立、有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律施行に伴い、同社は昭和62年に投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
平成2年	ジャーディン・フレミング投信株式会社（委託会社）設立
平成7年	ジャーディン・フレミング投資顧問株式会社とジャーディン・フレミング投信株式会社が合併し、ジャーディン・フレミング投信・投資顧問株式会社となる。
平成13年	ジェー・ピー・モルガン・フレミング・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社に商号変更
平成18年	JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社に商号変更
平成20年	JPモルガン信託銀行株式会社より資産運用部門の事業を譲受

東京海上アセットマネジメント投信株式会社

昭和60年12月	東京海上グループ（現：東京海上日動グループ）等の出資により、資産運用ビジネスの戦略的位置付けで、東京海上エム・シー投資顧問株式会社の社名にて資本金2億円で設立
昭和62年 2月	投資顧問業者として登録
昭和62年 6月	投資一任業務認可取得
平成 3年 4月	国内および海外年金の運用受託を開始
平成10年 5月	東京海上アセットマネジメント投信株式会社に社名変更し、投資信託法上の委託会社としての免許取得
平成19年 9月	金融商品取引業者として登録
平成26年 4月	東京海上アセットマネジメント株式会社に社名変更（予定）

ブラックロック・ジャパン株式会社

昭和63年3月	パークレイズ・デザート・ウェット投資顧問株式会社設立
昭和63年6月	証券投資顧問業者として登録
平成元年1月	投資一任業務認可を取得
平成6年11月	ビーゼットダブリュー投資顧問株式会社に商号変更
平成10年3月	投資信託委託業務免許を取得。パークレイズ投信株式会社に商号変更
平成13年6月	パークレイズ・グローバル・インベスターズ投信株式会社に商号変更
平成16年4月	パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社と合併し、パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社に商号変更
平成19年9月	証券取引法に基づき証券業登録、パークレイズ・グローバル・インベスターズ証券投信投資顧問株式会社に商号変更。同月末の金融商品取引法の施行を以って、パークレイズ・グローバル・インベスターズ株式会社に再度商号変更
平成19年12月	パークレイズ・グローバル・インベスターズ信託銀行より運用業務等の事業譲受け
平成20年7月	パークレイズ・グローバル・インベスターズ・サービス株式会社と合併
平成21年12月	ブラックロック・ジャパン株式会社と合併し、ブラックロック・ジャパン株式会社に商号変更

ユービーエス・グローバル・アセット・マネジメント株式会社

平成8年4月1日	ユー・ビー・エス投資顧問株式会社設立
平成10年4月28日	ユー・ビー・エス投信投資顧問株式会社に商号変更
平成12年7月1日	ユービーエス・プリンソン投資顧問株式会社と合併し、ユービーエス・アセット・マネジメント株式会社に商号変更
平成14年4月8日	ユービーエス・グローバル・アセット・マネジメント株式会社に商号変更

ベアリング投信投資顧問株式会社

昭和57年1月	ベアリング・インターナショナル・インベストメント・マネジメント社、東京駐在員事務所開設
昭和61年1月	日本法人ベアリング・インターナショナル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社設立
昭和62年2月	投資顧問業者として登録
昭和62年6月	投資一任契約業認可取得
平成7年1月	ベアリング・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社に商号を変更
平成7年9月	ベアリング投信株式会社に商号を変更
平成7年11月	投資信託委託業認可取得
平成11年4月	ベアリング投信投資顧問株式会社に商号を変更
平成19年9月	投資助言・代理業、投資運用業登録
平成21年6月	第二種金融商品取引業登録

大和住銀投信投資顧問株式会社

昭和48年6月	大和投資顧問株式会社設立
平成11年2月	証券投資信託委託業の認可取得
平成11年4月	住銀投資顧問株式会社及びエス・ビー・アイ・エム投信株式会社と合併し、大和住銀投信投資顧問株式会社へ商号を変更

ラザード・アセット・マネージメント・エルエルシー

1848年	ラザード・フレール・アンド・カンパニー・エルエルシー設立
1970年	ラザード・アセット・マネージメントがラザード・フレールの一部門として設立
2003年1月	ラザード・アセット・マネージメント・エルエルシー設立
2005年5月	ニューヨーク証券取引所にラザード・リミテッド（持株会社）の株式を上場

シンプレクス・アセット・マネージメント株式会社

平成11年11月	シンプレクス・アセット・マネージメント株式会社設立
----------	---------------------------

平成11年12月 投資顧問業（助言）登録
 平成12年 5月 投資一任業務認可取得
 平成13年 4月 投資信託委託業認可取得
 平成19年 9月 金融商品取引法施行にともなう金融商品取引業者の登録

マニユライフ・インベストメンツ・ジャパン株式会社

平成19年11月27日 マニユライフ・インベストメンツ・ジャパン株式会社設立
 平成20年 7月25日 投資運用業・第二種金融商品取引業登録
 平成20年 9月19日 社団法人投資信託協会 加入
 平成25年 1月 9日 投資助言・代理業登録

平成25年1月4日より一般社団法人へ移行し、「一般社団法人投資信託協会」となっています。

ロベコ・インスティテューショナル・アセット・マネジメント・ピーヴィー

（同社を100%保有するロベコ・グループ・エヌヴィーの沿革）

1929年 オランダのロッテルダムで創立
 1933年 独立した法人格（エヌヴィー）を取得し、第1号ファンドのグローバル株式ファンドを設定
 1974年 グローバル債券ファンドを設定
 1991年 ラボバンクと戦略的な提携関係を締結
 2001年 ラボバンクの完全子会社化
 2005年 東京オフィスを開設
 2013年 オリックス株式会社がラボバンクの保有するロベコ株式の約90.01%を取得し子会社化

アイエヌジー・アセット・マネジメントB.V.

1991年 ナショナル・ネーデルランデンとNMBポストバンクの合併により、INGグループ誕生
 1994年 INGグループの運用部門としてING・インベストメント・マネジメント設立
 1995年 アイエヌジー・アセット・マネジメントB.V.設立
 2013年 ING・インベストメント・マネジメントからING・インベストメント・マネジメント・インターナショナルに呼称変更

MFSインベストメント・マネジメント株式会社

平成10年 5月12日 マサチューセッツ・インベストメント・マネジメント株式会社設立
 平成10年 6月30日 投資顧問業の登録
 平成11年 2月18日 投資一任契約に係る業務の認可
 平成11年12月 9日 証券投資信託委託業の認可
 平成12年 8月 1日 エムエフエス・インベストメント・マネジメント株式会社に商号変更
 平成19年 9月30日 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業（投資助言・代理業、投資運用業）

のみなし登録

平成23年 6月22日 M F S インベストメント・マネジメント株式会社に商号変更

ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー

1928年	米国最初のバランス型ミューチュアル・ファンドであるウエリントン・ファンドを設立
1933年	ウエリントン・マネージメント社が運用会社として有限会社化
1967年	独立系投資顧問会社ソーンダイク・ドーラン・ペイン・アンド・ルイス社と合併
1979年	主要社員の買収により、パートナーシップによる保有形態へと移行
1996年	マサチューセッツ州のパートナーシップ法により有限責任(リミテッド)パートナーシップ形態となる

ニッセイアセットマネジメント株式会社

昭和60年7月1日 ニッセイ・ビーオーティー投資顧問株式会社（後のニッセイ投資顧問株式会社）が設立

され、投資顧問業務を開始

平成7年4月4日 ニッセイ投信株式会社が設立され、同年4月27日、証券投資信託委託業務を開始

平成10年7月1日 ニッセイ投信株式会社（存続会社）とニッセイ投資顧問株式会社（消滅会社）が合併し、

ニッセイアセットマネジメント投信株式会社として投資一任業務ならびに証券投資信託

委託業務の併営を開始

平成12年5月8日 定款を変更し商号をニッセイアセットマネジメント株式会社に変更

レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社

平成10年4月28日 会社設立

平成10年6月16日 証券投資信託委託会社免許取得

平成10年11月30日 投資顧問業登録

平成11年6月24日 投資一任契約に係る業務の認可取得

平成11年10月1日 スミス バーニー投資顧問株式会社と合併「エスエスピーシティ・アセット・マネジメント株式会社」に社名変更

平成13年4月1日 「シティグループ・アセット・マネジメント株式会社」に社名変更

平成18年1月1日 「レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社」に社名変更

平成19年9月30日 金融商品取引業登録

T & Dアセットマネジメント株式会社

昭和55年12月 第一投信株式会社設立

昭和61年3月 太陽生命投資顧問株式会社設立

昭和61年3月 大同生命投資顧問株式会社設立

昭和63年4月 太陽生命保険相互会社が、フランス商業銀行、ニューヨーク生命と共にジャパン・ガンマ投資顧問株式会社を設立

平成9年4月	太陽生命投資顧問株式会社がジャパン・ガンマ投資顧問を吸収合併し、太陽ライフガンマ投資顧問株式会社に社名変更
平成9年12月	第一投信株式会社が長期信用投信株式会社に社名変更
平成10年9月	大同生命投資顧問株式会社が年金運用を開始
平成11年2月	長期信用投信株式会社が大同生命保険相互会社の傘下に入る
平成11年4月	長期信用投信株式会社が大同ライフ投信株式会社に社名変更
平成11年10月	大同生命投資顧問株式会社が太陽ライフガンマ投資顧問株式会社と合併し、T&D太陽大同投資顧問株式会社に社名変更
平成14年10月	大同ライフ投信株式会社がT&D太陽大同投資顧問株式会社と合併し、T&Dアセットマネジメント株式会社に社名変更

3 【投資リスク】

< 訂正前 >

(1) 価額変動リスク

< 略 >

< FWヘッジFセレクト >（ 指定投資信託証券の変更に伴い内容が追加される場合があります。 ）

< 略 >

有価証券（指数）先物取引の利用に伴うリスク

先物の価格は、対象証券または指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建ている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下落すれば損失が発生します（売建ている場合は逆の結果となります。）。ファンドで行なっている株価指数先物取引について損失が発生した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

運用手法にかかるリスク・留意点

マーケット・ニュートラル戦略（現物株式のポートフォリオが有する株式市場全体の動きに依存して変動する要素（マーケット・リスク）を株価指数先物取引の売建てを利用して可能な限りヘッジすることをめざす戦略）に基づく運用を行なう場合

< 略 >

・現物株式取引、株価指数先物取引から発生する売買委託手数料等は、基準価額が下落する要因となります。

外国証券への投資に伴うリスク

< 略 >

< 訂正後 >

(1) 価額変動リスク

< 略 >

< FWヘッジFセレクト >（ 指定投資信託証券の変更に伴い内容が追加される場合があります。 ）

< 略 >

有価証券（指数）先物取引等の利用に伴うリスク

先物の価格は、対象証券または指数の値動き、先物市場の需給等を反映して変動します。先物を買建ている場合において、先物価格が上昇すれば収益が発生し、下落すれば損失が発生します（売建ている場合は逆の結果となります。）。ファンドで行なっている株価指数先物取引について損失が発生した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

有価証券指数等先渡取引を取引対象とする場合、取引相手方の信用状況が著しく悪化する信用リスク、合理的な条件で取引を行なう相手方が見出せなくなることによる流動性リスク等があります。

運用手法にかかるリスク・留意点

イ．マーケット・ニュートラル戦略（現物株式のポートフォリオが有する株式市場全体の動きに依存して変動する要素（マーケット・リスク）を株価指数先物取引の売建てを利用して可能な限りヘッジすることをめざす戦略）に基づく運用を行なう場合

< 略 >

- ・現物株式取引、株価指数先物取引から発生する売買委託手数料等は、基準価額が下落する要因となります。

ロ．株式ロング・ショート戦略（割安と判断される銘柄を買建て（ロング・ポジション）、割高と判断される銘柄を売建て（ショート・ポジション）するという2つのポジションを組み合わせる投資戦略）に基づく運用を行なう場合

- ・株式市場全体の動向による影響を受けにくい運用をめざしますが、その影響を全て排除できるわけではありません。
- ・株式市場やロング（買建て）・ショート（売建て）戦略により保有する株式の値動きの見通しが予測と異なった場合は、基準価額の下落要因になります。

外国証券への投資に伴うリスク

< 略 >

4 【手数料等及び税金】

(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次の率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

ファンド名	信託報酬率
FW日本株式セレクト FW日本債券セレクト FW外国株式セレクト FW外国株式EM+ FW外国債券セレクト FW外国債券EM+ FWヘッジFセレクト	年率0.462%（税抜0.44%）
FW J-REITセレクト	年率0.672%（税抜0.64%）
FW外国REITセレクト	年率0.9345%（税抜0.89%）
FWコモディティセレクト	年率0.357%（税抜0.34%）

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

< FW日本株式セレクト >

< FW日本債券セレクト >

< FW外国株式セレクト >

< FW外国株式EM+ >

< FW外国債券セレクト >

< FW外国債券EM+ >

< FWヘッジFセレクト >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.315% (税抜0.30%)	年率0.105% (税抜0.10%)	年率0.042% (税抜0.04%)

< FW J-REITセレクト >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.525% (税抜0.50%)	年率0.105% (税抜0.10%)	年率0.042% (税抜0.04%)

< FW外国REITセレクト >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.7875% (税抜0.75%)	年率0.105% (税抜0.10%)	年率0.042% (税抜0.04%)

< FWコモディティセレクト >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.21% (税抜0.20%)	年率0.105% (税抜0.10%)	年率0.042% (税抜0.04%)

< 略 >

< 略 >

< 略 >

組入ファンドの信託報酬を加えた実質的な信託報酬(税込、年率)の概算値(平成25年8月時点)	
FW日本株式セレクト	1.148 ± 0.21%程度
FW日本債券セレクト	0.800 ± 0.191%程度
FW外国株式セレクト	1.296 ± 0.09%程度
FW外国株式EM+	1.371 ± 0.17%程度
FW外国債券セレクト	0.915 ± 0.08%程度
FW外国債券EM+	0.954 ± 0.124%程度
FWコモディティセレクト	1.357%程度
FWヘッジFセレクト	0.937 ± 0.05%程度

< 略 >

< 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次の率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

ファンド名	信託報酬率
FW日本株式セレクト FW日本債券セレクト FW外国株式セレクト FW外国株式EM+ FW外国債券セレクト FW外国債券EM+ FWヘッジFセレクト	年率0.462%（税抜0.44%）
FW J-REITセレクト	年率0.672%（税抜0.64%）
FW外国REITセレクト	年率0.9345%（税抜0.89%）
FWコモディティセレクト	年率0.357%（税抜0.34%）

消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、以下の率となります。

ファンド名	信託報酬率（税込）
FW日本株式セレクト FW日本債券セレクト FW外国株式セレクト FW外国株式EM+ FW外国債券セレクト FW外国債券EM+ FWヘッジFセレクト	年率0.4752%
FW J-REITセレクト	年率0.6912%
FW外国REITセレクト	年率0.9612%
FWコモディティセレクト	年率0.3672%

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

< FW日本株式セレクト >

< FW日本債券セレクト >

< FW外国株式セレクト >

< FW外国株式EM+ >

< FW外国債券セレクト >

< FW外国債券EM+ >

< FWヘッジFセレクト >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.30% （税抜）	年率0.10% （税抜）	年率0.04% （税抜）

< FW J-REITセレクト >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.50% （税抜）	年率0.10% （税抜）	年率0.04% （税抜）

< FW外国REITセレクト >

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.75% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.04% (税抜)

<FWコモディティセレクト>

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.20% (税抜)	年率0.10% (税抜)	年率0.04% (税抜)

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

< 略 >

< 略 >

< 略 >

組入ファンドの信託報酬を加えた実質的な信託報酬（税込、年率）の概算値（平成26年2月時点）	
FW日本株式セレクト	1.152 ± 0.21%程度
FW日本債券セレクト	0.816 ± 0.207%程度
FW外国株式セレクト	1.312 ± 0.11%程度
FW外国株式EM+	1.384 ± 0.18%程度
FW外国債券セレクト	0.934 ± 0.10%程度
FW外国債券EM+	0.942 ± 0.112%程度
FWコモディティセレクト	1.357%程度
FWヘッジFセレクト	1.034 ± 0.17%程度

消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、以下の率となります。

組入ファンドの信託報酬を加えた実質的な信託報酬（税込、年率）の概算値	
FW日本株式セレクト	1.181 ± 0.22%程度
FW日本債券セレクト	0.839 ± 0.213%程度
FW外国株式セレクト	1.340 ± 0.11%程度
FW外国株式EM+	1.410 ± 0.19%程度
FW外国債券セレクト	0.955 ± 0.10%程度
FW外国債券EM+	0.964 ± 0.111%程度
FWコモディティセレクト	1.3672%程度
FWヘッジFセレクト	1.064 ± 0.18%程度

< 略 >

(5) 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

< 略 >

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります（「FW日本株式セレクト」のみ。））を選択することもできます。ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、上記イ．の表と同じです。

< 略 >

法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

期間	税率
平成25年12月31日まで	7.147%（所得税7%および復興特別所得税0.147%）
平成26年1月1日から	15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）

< 略 >

（ ）上記は、平成25年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。な

お、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税(配当控除の適用があります(「FW日本株式セレクト」のみ。))を選択することもできます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%)となります。

□. 解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益(解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料(税込)を含む)を控除した利益)については、譲渡所得とみなされ、20%(所得税15%および地方税5%)の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%)となります。

< 略 >

法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%(所得税15%)の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金(特別分配金)には課税されません。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%(所得税15%および復興特別所得税0.315%)となります。

< 略 >

() 上記は、平成26年1月1日現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

< 略 >

5 【運用状況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

ダイワファンドラップ 日本株式セレクト

(1) 【投資状況】（平成25年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	67,261,291,764	99.33
内 日本	67,261,291,764	99.33
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	453,455,796	0.67
純資産総額	67,714,747,560	100.00

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

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 【投資資産】（平成25年12月30日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	J Flag スモールキャップ・ファンド	日本	投資信託 受益証券	6,161,255,521	2.2195 13,675,314,320	2.7792 17,123,361,343	25.29
2	JPM日本株・ファンド	日本	投資信託 受益証券	17,732,144,219	0.8058 14,289,915,609	0.9334 16,551,183,414	24.44
3	ダイワ好配当日本株投信Q	日本	投資信託 受益証券	13,886,328,445	0.8122 11,279,265,895	0.9696 13,464,184,060	19.88
4	ダイワ・バリュー株・オープン	日本	投資信託 受益証券	11,433,612,672	0.7331 8,382,880,360	0.8817 10,081,016,292	14.89
5	スピリタス・ディスティレーション・ファン ド	日本	投資信託 受益証券	9,166,176,774	1.0286 9,428,979,632	1.0955 10,041,546,655	14.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	99.33%
合計	99.33%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	9,600,709,041	9,600,709,041	0.8635	0.8635
第2計算期間末 (平成21年6月15日)	11,860,164,259	11,860,164,259	0.6103	0.6103
第3計算期間末 (平成22年6月15日)	19,207,909,959	19,207,909,959	0.5829	0.5829
第4計算期間末 (平成23年6月15日)	20,490,790,512	20,490,790,512	0.5681	0.5681
第5計算期間末 (平成24年6月15日)	18,780,690,683	18,780,690,683	0.5246	0.5246
平成24年12月末日	24,994,956,487	-	0.6336	-
平成25年1月末日	29,840,175,872	-	0.7147	-
2月末日	31,655,332,379	-	0.7351	-
3月末日	37,675,413,112	-	0.8421	-
4月末日	42,789,360,840	-	0.9673	-
5月末日	39,678,485,533	-	0.9344	-
第6計算期間末 (平成25年6月17日)	37,648,317,879	37,648,317,879	0.8673	0.8673
6月末日	38,163,088,699	-	0.8701	-
7月末日	45,642,512,997	-	0.9314	-
8月末日	46,494,928,812	-	0.9077	-
9月末日	54,533,576,277	-	1.0113	-
10月末日	57,331,326,544	-	1.0126	-
11月末日	63,007,118,624	-	1.0534	-
12月末日	67,714,747,560	-	1.0779	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	-

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	13.7
第2計算期間	29.3
第3計算期間	4.5
第4計算期間	2.5
第5計算期間	7.7
第6計算期間	65.3
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	17.9

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	11,350,034,083	231,528,588
第2計算期間	10,762,981,901	2,448,741,385
第3計算期間	16,757,241,178	3,239,102,384
第4計算期間	9,632,605,236	6,516,166,319
第5計算期間	5,275,280,568	5,542,482,907
第6計算期間	23,354,265,266	15,743,634,524
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	25,887,090,779	7,824,298,124

(注) 当初設定数量は100,000口です。

ダイワファンドラップ 日本債券セレクト

(1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	91,222,713,297	99.30
内 日本	91,222,713,297	99.30
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	641,204,816	0.70
純資産総額	91,863,918,113	100.00

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

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	みずほ信 クレジットアクティブ・ファンド	日本	投資信託 受益証券	35,132,535,498	1.0301 36,191,211,884	1.0388 36,495,677,875	39.73
2	東京海上日本債ファンドM	日本	投資信託 受益証券	25,849,108,455	1.0523 27,203,172,906	1.0586 27,363,866,210	29.79

3	マニュアル日本債券アクティブ・ファンドM	日本	投資信託 受益証券	21,479,229,816	1.0496 22,546,410,149	1.0617 22,804,498,295	24.82
4	ダイワ日本国債ファンド	日本	投資信託 受益証券	4,534,637,340	1.0018 4,543,000,000	1.0053 4,558,670,917	4.96

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	99.30%
合計	99.30%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	10,794,204,899	10,794,204,899	0.9685	0.9685
第2計算期間末 (平成21年6月15日)	11,751,905,544	11,751,905,544	0.9949	0.9949
第3計算期間末 (平成22年6月15日)	20,547,526,202	20,547,526,202	1.0302	1.0302
第4計算期間末 (平成23年6月15日)	24,737,933,004	24,737,933,004	1.0407	1.0407
第5計算期間末 (平成24年6月15日)	25,170,960,563	25,170,960,563	1.0631	1.0631
平成24年12月末日	31,501,578,378	-	1.0671	-
平成25年1月末日	37,421,815,888	-	1.0687	-
2月末日	42,143,012,351	-	1.0760	-
3月末日	45,874,849,333	-	1.0881	-
4月末日	50,362,986,534	-	1.0827	-
5月末日	55,283,873,719	-	1.0667	-
第6計算期間末 (平成25年6月17日)	55,935,771,979	55,935,771,979	1.0704	1.0704
6月末日	56,616,147,181	-	1.0700	-
7月末日	61,983,072,529	-	1.0726	-
8月末日	66,816,327,395	-	1.0772	-

9月末日	73,513,849,003	-	1.0813	-
10月末日	80,421,197,323	-	1.0877	-
11月末日	86,519,439,997	-	1.0882	-
12月末日	91,863,918,113	-	1.0837	-

分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	-

収益率の推移

	収益率(%)
第1計算期間	3.2
第2計算期間	2.7
第3計算期間	3.5
第4計算期間	1.0
第5計算期間	2.2
第6計算期間	0.7
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	1.3

(4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	11,609,503,965	463,941,613
第2計算期間	6,693,695,923	6,027,772,371
第3計算期間	10,202,147,549	2,068,200,022
第4計算期間	7,355,835,005	3,531,043,282
第5計算期間	3,568,084,361	3,662,470,907
第6計算期間	34,030,885,071	5,449,040,736
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	37,133,911,326	6,078,845,594

(注) 当初設定数量は100,000口です。

ダイワファンドラップ 外国株式セレクト

(1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	21,120,242,966	61.93
内 日本	21,120,242,966	61.93

投資証券		12,304,386,516	36.08
	内 ルクセンブルグ	12,304,386,516	36.08
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		680,667,141	2.00
純資産総額		34,105,296,623	100.00

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

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	MFS外国株コア・ファンド	日本	投資信託 受益証券	9,057,220,961	1.4757 13,365,834,174	1.7682 16,014,978,103	46.96
2	ROBECO US PREMIUM EQUITIES I USD SHARES	ルクセンブルグ	投資証券	453,409.88	18,451.68 8,366,203,931	20,658.54 9,366,789,641	27.46
3	ダイワ海外好配当株ファンドM	日本	投資信託 受益証券	6,416,873,886	0.6891 4,422,117,839	0.7956 5,105,264,863	14.97
4	ING(L) INVEST EUROPE OPPORTUNITIES CLASS I	ルクセンブルグ	投資証券	2,790.7	966,749.54 2,697,908,293	1,052,638.00 2,937,596,875	8.61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	61.93%
投資証券	36.08%
合計	98.00%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	3,492,712,177	3,492,712,177	0.8628	0.8628

第2計算期間末 (平成21年6月15日)	3,328,769,047	3,328,769,047	0.5239	0.5239
第3計算期間末 (平成22年6月15日)	5,246,634,721	5,246,634,721	0.5449	0.5449
第4計算期間末 (平成23年6月15日)	6,705,559,158	6,705,559,158	0.5813	0.5813
第5計算期間末 (平成24年6月15日)	6,551,733,560	6,551,733,560	0.5353	0.5353
平成24年12月末日	9,875,942,591	-	0.6631	-
平成25年1月末日	12,105,610,098	-	0.7407	-
2月末日	12,734,832,252	-	0.7379	-
3月末日	14,297,925,023	-	0.7698	-
4月末日	16,145,238,163	-	0.8172	-
5月末日	18,012,658,570	-	0.8655	-
第6計算期間末 (平成25年6月17日)	16,717,453,342	16,717,453,342	0.8017	0.8017
6月末日	16,972,244,565	-	0.8044	-
7月末日	19,854,254,796	-	0.8504	-
8月末日	21,495,222,689	-	0.8349	-
9月末日	24,970,235,165	-	0.8801	-
10月末日	28,292,895,369	-	0.9111	-
11月末日	31,643,671,947	-	0.9548	-
12月末日	34,105,296,623	-	0.9989	-

分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	-

収益率の推移

	収益率(%)
第1計算期間	13.7
第2計算期間	39.3
第3計算期間	4.0
第4計算期間	6.7
第5計算期間	7.9
第6計算期間	49.8
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	17.4

(4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	4,118,537,390	70,645,272
第2計算期間	4,589,184,871	2,282,944,896
第3計算期間	4,838,200,545	1,564,254,205
第4計算期間	3,601,624,611	1,693,627,830
第5計算期間	2,921,861,435	2,218,411,343
第6計算期間	12,385,335,559	3,771,957,549
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	16,606,367,785	3,727,297,888

(注) 当初設定数量は100,000口です。

ダイワファンドラップ 外国株式セレクト エマージングプラス

(1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	25,944,610,938	54.97
内 日本	25,944,610,938	54.97
投資証券	20,799,094,575	44.07
内 アイルランド	6,244,814,005	13.23
内 ルクセンブルグ	14,554,280,570	30.84
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	450,951,583	0.96
純資産総額	47,194,657,096	100.00

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

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	MFS外国株コア・ファンド	日本	投資信託 受益証券	9,985,792,310	1.4366 14,346,286,136	1.7682 17,656,877,962	37.41
2	ROBECO US PREMIUM EQUITIES I USD SHARES	ルクセンブルグ	投資証券	561,170.41	18,364.20 10,305,479,044	20,658.54 11,592,965,654	24.56
3	LAZARD GL ACTIVE-EM MK EQ	アイルランド	投資証券	492,366.44	12,043.02 5,929,630,734	12,683.26 6,244,814,005	13.23
4	ダイワ海外好配当株ファンドM	日本	投資信託 受益証券	6,996,221,967	0.6720 4,701,855,439	0.7956 5,566,194,196	11.79
5	ING(L) INVEST EUROPE OPPORTUNITIES CLASS I	ルクセンブルグ	投資証券	2,813.23	942,859.81 2,652,483,569	1,052,638.00 2,961,314,916	6.27
6	UBS BRICsプラス・ファンド	日本	投資信託 受益証券	3,617,143,515	0.6675 2,414,739,624	0.7524 2,721,538,780	5.77

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	54.97%
投資証券	44.07%
合計	99.04%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	13,837,859,816	13,837,859,816	0.8660	0.8660
第2計算期間末 (平成21年6月15日)	11,712,486,928	11,712,486,928	0.5360	0.5360
第3計算期間末 (平成22年6月15日)	17,503,206,117	17,503,206,117	0.5675	0.5675
第4計算期間末 (平成23年6月15日)	20,499,194,557	20,499,194,557	0.5997	0.5997
第5計算期間末 (平成24年6月15日)	18,556,309,789	18,556,309,789	0.5381	0.5381
平成24年12月末日	23,699,879,432	-	0.6668	-
平成25年1月末日	26,983,145,057	-	0.7411	-
2月末日	27,392,371,326	-	0.7364	-
3月末日	29,435,688,487	-	0.7623	-
4月末日	32,592,542,544	-	0.8061	-
5月末日	35,675,799,122	-	0.8483	-
第6計算期間末 (平成25年6月17日)	32,616,578,727	32,616,578,727	0.7771	0.7771
6月末日	32,901,410,084	-	0.7787	-
7月末日	36,177,052,715	-	0.8220	-
8月末日	36,180,569,191	-	0.8019	-
9月末日	40,129,892,275	-	0.8556	-
10月末日	42,825,339,545	-	0.8873	-
11月末日	45,053,598,679	-	0.9206	-
12月末日	47,194,657,096	-	0.9592	-

分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	-

収益率の推移

	収益率(%)
第1計算期間	13.4
第2計算期間	38.1
第3計算期間	5.9
第4計算期間	5.7
第5計算期間	10.3
第6計算期間	44.4
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	16.8

(4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	16,339,973,194	361,506,852
第2計算期間	12,221,972,717	6,348,818,102
第3計算期間	14,945,058,922	5,956,527,432
第4計算期間	8,812,077,305	5,472,458,530
第5計算期間	6,207,140,351	5,902,877,938
第6計算期間	16,743,277,983	9,252,583,053
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	13,565,682,638	6,460,594,203

(注) 当初設定数量は100,000口です。

ダイワファンドラップ 外国債券セレクト

(1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	23,557,137,620	98.56
内 日本	16,469,667,572	68.90
内 ケイマン諸島	7,087,470,048	29.65
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	344,873,631	1.44
純資産総額	23,902,011,251	100.00

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

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	WELLINGTON MGMT GLOBAL AGGREGATE NON YEN BOND PORT CLASS B	ケイマン諸 島	投資信託 受益証券	657,464.75	10,248.59 6,738,091,132	10,780.00 7,087,470,048	29.65
2	ベアリング外国債券ファンドM	日本	投資信託 受益証券	7,626,571,427	0.8683 6,622,412,391	0.9261 7,062,967,798	29.55
3	ブラックロック外国債券ファンドM	日本	投資信託 受益証券	4,571,258,698	1.1702 5,349,425,606	1.2878 5,886,866,951	24.63
4	モルガン・スタンレー・グローバル・ボンド・ オープンM	日本	投資信託 受益証券	3,764,527,084	0.8612 3,242,136,928	0.9350 3,519,832,823	14.73

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	98.56%
合計	98.56%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	2,192,244,689	2,192,244,689	0.9899	0.9899
第2計算期間末 (平成21年6月15日)	4,567,202,069	4,567,202,069	0.8838	0.8838
第3計算期間末 (平成22年6月15日)	7,061,149,675	7,061,149,675	0.8419	0.8419
第4計算期間末 (平成23年6月15日)	7,815,585,200	7,815,585,200	0.8180	0.8180

第5計算期間末 (平成24年6月15日)	6,753,027,786	6,753,027,786	0.8158	0.8158
平成24年12月末日	8,563,236,781	-	0.9244	-
平成25年1月末日	9,495,644,820	-	0.9747	-
2月末日	10,092,279,894	-	0.9741	-
3月末日	11,039,630,062	-	0.9946	-
4月末日	12,759,043,167	-	1.0610	-
5月末日	13,657,068,157	-	1.0620	-
第6計算期間末 (平成25年6月17日)	13,089,185,573	13,089,185,573	1.0050	1.0050
6月末日	13,320,488,376	-	1.0089	-
7月末日	14,848,678,685	-	1.0240	-
8月末日	15,977,207,942	-	1.0162	-
9月末日	18,065,746,684	-	1.0392	-
10月末日	19,945,528,009	-	1.0497	-
11月末日	22,091,987,635	-	1.0813	-
12月末日	23,902,011,251	-	1.1100	-

分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	-

収益率の推移

	収益率(%)
第1計算期間	1.0
第2計算期間	10.7
第3計算期間	4.7
第4計算期間	2.8
第5計算期間	0.3
第6計算期間	23.2
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	8.9

(4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,321,865,531	107,268,330
第2計算期間	4,046,278,985	1,093,035,911
第3計算期間	4,482,728,127	1,263,593,480
第4計算期間	2,906,642,075	1,738,924,103
第5計算期間	1,053,485,709	2,330,664,495

第6計算期間	7,680,434,430	2,933,524,001
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	9,553,018,896	1,432,073,472

(注) 当初設定数量は100,000口です。

ダイワファンドラップ 外国債券セレクト エマージングプラス

(1) 投資状況 (平成25年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	19,872,304,231	99.12
内 日本	15,044,427,417	75.04
内 ケイマン諸島	4,827,876,814	24.08
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	176,502,195	0.88
純資産総額	20,048,806,426	100.00

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

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産 (平成25年12月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	WELLINGTON MGMT GLOBAL AGGREGATE NON YEN BOND PORT CLASS B	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	447,854.99	10,274.00 4,601,262,360	10,780.00 4,827,876,814	24.08
2	ベアリング外国債券ファンドM	日本	投資信託 受益証券	5,127,858,996	0.8644 4,432,905,583	0.9261 4,748,910,216	23.69
3	ブラックロック外国債券ファンドM	日本	投資信託 受益証券	3,072,666,960	1.1591 3,561,733,920	1.2878 3,956,980,511	19.74
4	T.ロウ・プライス新興国債券オープンM	日本	投資信託 受益証券	2,900,934,818	0.8411 2,440,112,593	0.8892 2,579,511,240	12.87
5	モルガン・スタンレー・グローバル・ボンド・ オープンM	日本	投資信託 受益証券	2,531,964,492	0.8551 2,165,163,112	0.9350 2,367,386,800	11.81
6	ブラックロック・エマージング・ボンド・ファン ドM	日本	投資信託 受益証券	1,389,831,869	0.9162 1,273,378,305	1.0013 1,391,638,650	6.94

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	99.12%
合計	99.12%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	7,839,632,448	7,839,632,448	0.9851	0.9851
第2計算期間末 (平成21年6月15日)	7,661,742,696	7,661,742,696	0.8755	0.8755
第3計算期間末 (平成22年6月15日)	12,001,208,474	12,001,208,474	0.8583	0.8583
第4計算期間末 (平成23年6月15日)	12,517,859,902	12,517,859,902	0.8354	0.8354
第5計算期間末 (平成24年6月15日)	10,117,659,291	10,117,659,291	0.8430	0.8430
平成24年12月末日	11,437,382,539	-	0.9641	-
平成25年1月末日	12,145,710,139	-	1.0172	-
2月末日	12,468,932,602	-	1.0174	-
3月末日	13,201,557,223	-	1.0380	-
4月末日	14,932,611,650	-	1.1088	-
5月末日	15,768,999,513	-	1.1082	-
第6計算期間末 (平成25年6月17日)	14,867,511,007	14,867,511,007	1.0418	1.0418
6月末日	15,010,976,827	-	1.0438	-
7月末日	15,964,757,931	-	1.0628	-
8月末日	16,291,056,722	-	1.0498	-
9月末日	17,448,669,899	-	1.0773	-
10月末日	18,221,626,613	-	1.0879	-
11月末日	19,183,077,648	-	1.1176	-
12月末日	20,048,806,426	-	1.1499	-

分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000

平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	-
----------------------------	---

収益率の推移

	収益率(%)
第1計算期間	1.5
第2計算期間	11.1
第3計算期間	2.0
第4計算期間	2.7
第5計算期間	0.9
第6計算期間	23.6
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	8.7

(4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	8,204,326,777	246,123,482
第2計算期間	4,629,678,822	3,836,310,832
第3計算期間	6,670,375,103	1,439,940,806
第4計算期間	3,708,491,336	2,706,304,070
第5計算期間	988,431,902	3,970,830,604
第6計算期間	5,784,841,520	3,516,100,489
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	4,946,672,301	1,839,730,408

(注) 当初設定数量は100,000口です。

ダイワファンドラップ J-REITセレクト

(1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	20,819,381,159	99.96
内 日本	20,819,381,159	99.96
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	8,231,483	0.04
純資産総額	20,827,612,642	100.00

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

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
-----	----	--------------	--------------------	-------------------	-------------------	-----------------

1	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	11,969,977,094	1.4878 17,809,382,229	1.7393 20,819,381,159	99.96
---	------------------------	----	-----------	----------------	--------------------------	--------------------------	-------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.96%
合計	99.96%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	2,913,880,444	2,913,880,444	0.8026	0.8026
第2計算期間末 (平成21年6月15日)	3,123,949,537	3,123,949,537	0.5542	0.5542
第3計算期間末 (平成22年6月15日)	5,409,902,870	5,409,902,870	0.5936	0.5936
第4計算期間末 (平成23年6月15日)	6,370,765,528	6,370,765,528	0.7111	0.7111
第5計算期間末 (平成24年6月15日)	5,563,613,222	5,563,613,222	0.6693	0.6693
平成24年12月末日	7,698,585,519	-	0.8466	-
平成25年1月末日	9,369,821,892	-	0.9417	-
2月末日	10,521,400,442	-	1.0083	-
3月末日	13,492,918,049	-	1.2559	-
4月末日	13,553,843,264	-	1.2242	-
5月末日	12,056,354,794	-	1.0553	-
第6計算期間末 (平成25年6月17日)	11,676,168,328	11,676,168,328	1.0082	1.0082
6月末日	12,800,081,943	-	1.0856	-
7月末日	13,695,254,569	-	1.0246	-
8月末日	14,887,109,321	-	1.0189	-
9月末日	18,806,661,090	-	1.1796	-
10月末日	18,777,922,067	-	1.1593	-

11月末日	19,441,682,063	-	1.1592	-
12月末日	20,827,612,642	-	1.2085	-

分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	-

収益率の推移

	収益率(%)
第1計算期間	19.7
第2計算期間	30.9
第3計算期間	7.1
第4計算期間	19.8
第5計算期間	5.9
第6計算期間	50.6
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	12.3

(4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	3,697,283,665	66,850,655
第2計算期間	3,187,431,222	1,181,048,857
第3計算期間	4,391,288,015	914,269,140
第4計算期間	2,334,890,880	2,490,371,877
第5計算期間	1,078,476,083	1,724,468,528
第6計算期間	7,167,251,513	3,898,162,690
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	7,364,964,183	1,829,085,642

(注) 当初設定数量は100,000口です。

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

(1) 投資状況(平成25年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	27,370,000,000	97.88
内 日本	27,370,000,000	97.88
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	592,737,018	2.12
純資産総額	27,962,737,018	100.00

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

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	5,000	592,500.00 2,962,500,000	612,000.00 3,060,000,000	10.94
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	4,000	541,000.00 2,164,000,000	564,000.00 2,256,000,000	8.07
3	日本リテールファンド	日本	投資証券	8,200	195,400.00 1,602,280,000	214,200.00 1,756,440,000	6.28
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	11,000	145,200.00 1,597,200,000	151,300.00 1,664,300,000	5.95
5	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	2,400	475,911.80 1,142,188,326	520,000.00 1,248,000,000	4.46
6	日本プロロジスリート	日本	投資証券	1,200	927,483.54 1,112,980,259	1,006,000.00 1,207,200,000	4.32
7	森ヒルズリート	日本	投資証券	1,700	659,000.00 1,120,300,000	698,000.00 1,186,600,000	4.24
8	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	4,800	219,000.00 1,051,200,000	227,000.00 1,089,600,000	3.90
9	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	18,000	45,150.00 812,700,000	50,400.00 907,200,000	3.24
10	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	800	1,004,000.00 803,200,000	1,115,000.00 892,000,000	3.19
11	GLP投資法人	日本	投資証券	7,600	98,300.00 747,080,000	102,800.00 781,280,000	2.79
12	ケネディクス不動産投資法人	日本	投資証券	1,500	441,718.45 662,577,680	499,500.00 749,250,000	2.68
13	API投資法人	日本	投資証券	900	789,097.30 710,187,571	829,000.00 746,100,000	2.67
14	NMF投資法人	日本	投資証券	6,500	99,900.00 649,350,000	108,400.00 704,600,000	2.52
15	産業ファンド	日本	投資証券	800	884,000.00 707,200,000	877,000.00 701,600,000	2.51
16	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	1,600	329,000.00 526,400,000	337,000.00 539,200,000	1.93
17	イオンリート投資	日本	投資証券	4,000	113,453.90 453,815,636	129,200.00 516,800,000	1.85
18	グローバル・ワン不動産投資法人	日本	投資証券	700	580,462.24 406,323,571	715,000.00 500,500,000	1.79
19	トップリート投資法人	日本	投資証券	1,000	437,500.00 437,500,000	494,000.00 494,000,000	1.77
20	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	1,000	417,000.00 417,000,000	491,500.00 491,500,000	1.76

21	大和ハウスリート	日本	投資証券	600	744,000.00 446,400,000	790,000.00 474,000,000	1.70
22	オリックス不動産投資	日本	投資証券	3,300	120,700.00 398,310,000	131,700.00 434,610,000	1.55
23	福岡リート投資法人	日本	投資証券	500	781,000.00 390,500,000	852,000.00 426,000,000	1.52
24	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	600	692,000.00 415,200,000	708,000.00 424,800,000	1.52
25	星野リゾート・リート	日本	投資証券	600	599,053.03 359,431,822	663,000.00 397,800,000	1.42
26	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	900	407,000.00 366,300,000	419,500.00 377,550,000	1.35
27	森トラスト総合リート	日本	投資証券	450	856,460.50 385,407,248	838,000.00 377,100,000	1.35
28	ケネディクスレジデンシャル	日本	投資証券	1,500	209,500.00 314,250,000	227,600.00 341,400,000	1.22
29	東急リアル・エステート	日本	投資証券	500	592,000.00 296,000,000	649,000.00 324,500,000	1.16
30	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	2,500	120,800.00 302,000,000	123,300.00 308,250,000	1.10

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.88%
合計	97.88%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

ダイワファンドラップ 外国REITセレクト

(1) 投資状況 (平成25年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	15,023,224,079	99.35
内 日本	15,023,224,079	99.35
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	98,047,997	0.65
純資産総額	15,121,272,076	100.00

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

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ海外REIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	14,942,534,394	0.9272 13,854,936,800	1.0054 15,023,224,079	99.35

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.35%
合計	99.35%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	3,041,509,520	3,041,509,520	0.8706	0.8706
第2計算期間末 (平成21年6月15日)	3,634,314,772	3,634,314,772	0.4735	0.4735
第3計算期間末 (平成22年6月15日)	6,158,535,769	6,158,535,769	0.6182	0.6182
第4計算期間末 (平成23年6月15日)	6,864,025,137	6,864,025,137	0.6903	0.6903
第5計算期間末 (平成24年6月15日)	6,137,747,633	6,137,747,633	0.6899	0.6899
平成24年12月末日	7,584,931,460	-	0.8324	-
平成25年1月末日	8,389,486,794	-	0.9025	-
2月末日	8,737,445,263	-	0.9177	-
3月末日	9,520,119,410	-	0.9532	-

4月末日	10,817,510,411	-	1.0488	-
5月末日	10,879,861,361	-	1.0357	-
第6計算期間末 (平成25年6月17日)	9,984,791,445	9,984,791,445	0.9480	0.9480
6月末日	10,327,984,295	-	0.9687	-
7月末日	11,246,706,441	-	0.9895	-
8月末日	11,125,836,252	-	0.9286	-
9月末日	12,510,122,121	-	0.9687	-
10月末日	13,923,729,773	-	1.0166	-
11月末日	14,339,266,165	-	1.0108	-
12月末日	15,121,272,076	-	1.0326	-

分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	-

収益率の推移

	収益率(%)
第1計算期間	12.9
第2計算期間	45.6
第3計算期間	30.6
第4計算期間	11.7
第5計算期間	0.1
第6計算期間	37.4
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	4.5

(4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	3,573,254,195	79,769,101
第2計算期間	5,123,099,130	941,084,531
第3計算期間	5,080,098,202	2,793,119,475
第4計算期間	2,423,367,128	2,441,732,112
第5計算期間	1,070,973,020	2,118,516,215
第6計算期間	4,625,041,069	2,988,956,395
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	5,246,142,509	1,248,092,474

(注) 当初設定数量は100,000口です。

(参考) ダイワ海外REIT・マザーファンド

(1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	14,948,347,696	96.80
内 香港	164,860,572	1.07
内 シンガポール	419,099,392	2.71
内 イギリス	1,443,154,093	9.35
内 アイルランド	42,960,938	0.28
内 オランダ	271,960,408	1.76
内 フランス	651,289,204	4.22
内 ドイツ	102,833,544	0.67
内 カナダ	212,867,785	1.38
内 アメリカ	9,977,690,371	64.61
内 オーストラリア	1,661,631,389	10.76
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	494,528,650	3.20
純資産総額	15,442,876,346	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	17,166,558	0.11
内 日本	17,166,558	0.11
為替予約取引(売建)	17,202,996	0.11
内 日本	17,202,996	0.11

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

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(注3) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	85,873	15,948.03 1,369,513,288	16,147.85 1,386,664,821	8.98
2	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	60,343	8,994.08 542,733,232	9,474.56 571,723,434	3.70
3	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	301,386	1,622.04 488,876,139	1,659.40 500,122,339	3.24
4	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	126,072	3,931.15 495,609,600	3,919.45 494,133,417	3.20
5	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	87,137	5,720.46 498,473,055	5,463.41 476,065,819	3.08
6	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	41,580	11,149.94 463,618,333	10,581.15 439,964,466	2.85

7	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	68,441	6,568.95 449,591,463	6,032.52 412,871,948	2.67
8	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	39,930	9,568.14 382,059,154	9,701.14 387,366,900	2.51
9	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	14,192	25,811.64 366,318,901	26,493.38 375,994,084	2.43
10	UDR INC	アメリカ	投資証券	137,678	2,532.52 348,684,698	2,460.85 338,805,801	2.19
11	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	20,888	16,638.23 347,539,854	15,926.53 332,673,501	2.15
12	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	2,040,687	158.04 322,571,036	157.10 320,611,110	2.08
13	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	711,136	442.98 315,058,290	442.89 314,955,023	2.04
14	HAMMERSON PLC	イギリス	投資証券	329,071	893.82 294,188,253	868.80 285,896,885	1.85
15	HCP INC	アメリカ	投資証券	70,081	4,378.95 306,886,844	3,846.73 269,583,036	1.75
16	HOME PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	44,864	6,138.33 275,392,263	5,704.76 255,938,384	1.66
17	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	投資証券	45,460	6,605.31 300,281,899	5,606.74 254,882,764	1.65
18	DEXUS PROPERTY GROUP	オーストラリア	投資証券	2,667,721	97.06 259,214,884	93.70 249,981,997	1.62
19	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	オーストラリア	投資証券	1,388,973	186.20 258,709,993	176.68 245,417,361	1.59
20	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	45,705	5,079.16 232,146,262	4,926.98 225,187,735	1.46
21	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	20,951	10,600.86 222,100,100	10,717.10 224,534,153	1.45
22	DOUGLAS EMMETT INC	アメリカ	投資証券	89,930	2,462.75 221,484,215	2,488.25 223,769,033	1.45
23	FEDERATION CENTRES	オーストラリア	投資証券	918,517	208.29 191,326,352	214.45 196,977,808	1.28
24	TAUBMAN CENTERS INC	アメリカ	投資証券	26,583	6,993.57 185,911,561	6,755.49 179,581,430	1.16
25	GLIMCHER REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	180,113	1,082.24 194,940,827	982.23 176,913,257	1.15
26	AMERICAN ASSETS TRUST INC	アメリカ	投資証券	52,882	3,205.75 169,527,210	3,335.59 176,392,855	1.14
27	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	アメリカ	投資証券	63,659	3,031.01 192,951,473	2,746.46 174,837,114	1.13
28	KLEPIERRE	フランス	投資証券	36,802	4,500.90 165,642,177	4,709.77 173,329,084	1.12
29	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	290,195	540.21 156,769,099	582.09 168,921,349	1.09
30	STRATEGIC HOTELS & RESORTS	アメリカ	投資証券	164,556	918.57 151,166,069	992.77 163,366,885	1.06

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.80%
合計	96.80%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2014年1月	買建	123,058	12,919,262	12,967,875	0.08%
		豪ドル買/円売 2014年1月	買建	45,055	4,166,583	4,198,683	0.03%
		米ドル売/円買 2014年1月	売建	39,910	4,166,583	4,205,694	0.03%
		英ポンド売/円買 2014年1月	売建	74,809	12,919,262	12,997,302	0.08%

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

(注2) 為替予約取引の時価については、原則として対顧客先物売買相場の仲値で評価しています。

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワファンドラップ コモディティセレクト

(1) 投資状況（平成25年12月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	14,930,381,111	98.56
内 ケイマン諸島	14,930,381,111	98.56
親投資信託受益証券	24,321,053	0.16
内 日本	24,321,053	0.16
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	193,276,778	1.28
純資産総額	15,147,978,942	100.00

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

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産（平成25年12月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
-----	----	--------------	--------------------	-------------------	-------------------	-----------------

1	DAIWA RICIFUND	ケイマン諸島	投資信託受益証券	1,480,565.51	10,101.52 14,956,023,936	10,084.24 14,930,381,111	98.56
2	ダイワ・マネー・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	23,865,228	1.0186 24,309,121	1.0191 24,321,053	0.16

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	98.56%
親投資信託受益証券	0.16%
合計	98.72%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	2,632,062,891	2,746,766,259	1.1473	1.1973
第2計算期間末 (平成21年6月15日)	2,635,665,773	2,635,665,773	0.5929	0.5929
第3計算期間末 (平成22年6月15日)	4,764,867,435	4,764,867,435	0.5112	0.5112
第4計算期間末 (平成23年6月15日)	5,954,173,567	5,954,173,567	0.6168	0.6168
第5計算期間末 (平成24年6月15日)	4,431,337,013	4,431,337,013	0.4831	0.4831
平成24年12月末日	6,207,188,646	-	0.5830	-
平成25年1月末日	7,376,793,799	-	0.6339	-
2月末日	7,706,857,672	-	0.6238	-
3月末日	8,410,380,334	-	0.6394	-
4月末日	9,038,917,872	-	0.6334	-
5月末日	10,181,956,315	-	0.6488	-
第6計算期間末 (平成25年6月17日)	9,601,866,066	9,601,866,066	0.6077	0.6077
6月末日	9,801,080,682	-	0.6142	-
7月末日	10,770,256,778	-	0.6282	-

8月末日	12,010,526,733	-	0.6618	-
9月末日	12,318,610,852	-	0.6339	-
10月末日	13,022,390,785	-	0.6297	-
11月末日	13,949,452,506	-	0.6412	-
12月末日	15,147,978,942	-	0.6741	-

分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0500
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	-

収益率の推移

	収益率(%)
第1計算期間	19.7
第2計算期間	48.3
第3計算期間	13.8
第4計算期間	20.7
第5計算期間	21.7
第6計算期間	25.8
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	7.3

(4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	2,412,917,551	118,950,184
第2計算期間	2,914,106,719	762,565,188
第3計算期間	5,693,469,456	818,164,420
第4計算期間	2,989,616,378	2,657,620,495
第5計算期間	1,270,823,962	1,750,755,216
第6計算期間	8,814,569,779	2,187,400,920
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	8,485,326,871	2,000,091,345

(注) 当初設定数量は100,000口です。

(参考) ダイワ・マネー・マザーファンド

(1) 投資状況(平成25年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	8,799,378,577	60.22

	内 日本	8,799,378,577	60.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		5,811,962,553	39.78
純資産総額		14,611,341,130	100.00

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

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産 (平成25年12月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	400 国庫短期証券	日本	国債証券	1,400,000,000	99.99 1,399,968,976	99.99 1,399,968,976	- 2014/01/14	9.58
2	418 国庫短期証券	日本	国債証券	1,400,000,000	99.98 1,399,803,188	99.98 1,399,803,188	- 2014/03/24	9.58
3	403 国庫短期証券	日本	国債証券	1,200,000,000	99.99 1,199,957,116	99.99 1,199,957,116	- 2014/01/20	8.21
4	399 国庫短期証券	日本	国債証券	1,000,000,000	99.99 999,990,922	99.99 999,990,922	- 2014/01/09	6.84
5	415 国庫短期証券	日本	国債証券	1,000,000,000	99.98 999,882,130	99.98 999,882,130	- 2014/03/17	6.84
6	409 国庫短期証券	日本	国債証券	800,000,000	99.99 799,936,353	99.99 799,936,353	- 2014/02/17	5.47
7	407 国庫短期証券	日本	国債証券	800,000,000	99.99 799,932,800	99.99 799,932,800	- 2014/02/10	5.47
8	410 国庫短期証券	日本	国債証券	700,000,000	99.99 699,941,970	99.99 699,941,970	- 2014/02/24	4.79
9	406 国庫短期証券	日本	国債証券	500,000,000	99.99 499,965,122	99.99 499,965,122	- 2014/02/03	3.42

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	60.22%
合計	60.22%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) ダイワ“ RICI ”ファンド

(1) 有価証券(平成25年12月30日現在)

(単位: USドル)

銘柄名	数量	評価額	備考
US T-BILL 0PCT 20MAR14	36,000,000	35,997,775.79	
US T-BILL 0PCT 19JUN14	20,000,000	19,991,641.68	
US T-BILL 0PCT 13FEB14	14,000,000	13,998,832.82	
US T-BILL 0PCT 29MAY14	13,000,000	12,994,366.65	
US T-BILL 0PCT 9JAN14	12,500,000	12,499,794.17	
US T-BILL 0PCT 3APR14	9,000,000	8,998,625.45	

(2) 商品先物(平成25年12月30日現在)

(単位: USドル)

銘柄名	買建/売建	数量	評価損益	備考
MILLING WHEAT (EOP) MAR-14	買建	110	-19,275.46	
RAPESEED EURO FUT (EOP) FEB-14	買建	59	1,589.22	
BRENT CRUDE OIL (ICE) FEB-14	買建	192	181,620.00	
COFFEE ROBUSTA (LIF) MAR-14	買建	190	95,630.00	
COPPER GRADE A (LME) JAN-14	買建	34	-7,656.25	
COPPER GRADE A (LME) JAN-14	売建	34	-211,637.50	
COPPER GRADE A (LME) FEB-14	買建	35	211,525.00	
GAS OIL (ICE) FEB-14	買建	19	-50.00	
NO 7 COCOA (LIF) MAR-14	買建	54	84,212.43	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-14	買建	129	-335,065.00	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-14	売建	129	-98,591.25	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) FEB-14	買建	139	105,191.25	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-14	買建	17	-26,598.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-14	売建	17	-93,978.00	
PRIMARY NICKEL (LME) FEB-14	買建	19	104,376.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-14	買建	62	126,600.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-14	売建	62	-257,250.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) FEB-14	買建	65	265,612.50	
STANDARD LEAD (LME) JAN-14	買建	55	20,100.00	
STANDARD LEAD (LME) JAN-14	売建	55	-202,400.00	
STANDARD LEAD (LME) FEB-14	買建	59	216,437.50	
TIN (LME) JAN-14	買建	13	2,760.00	
TIN (LME) JAN-14	売建	13	-25,475.00	
TIN (LME) FEB-14	買建	14	23,445.00	
TIN (LME) FEB-14	売建	1	-1,085.00	
WHITE SUGAR (LIF) MAR-14	買建	66	-127,620.00	
RUBBER (TCM) MAY-14	買建	121	44,449.78	
CORN (CBT) MAR-14	買建	339	-100,375.00	
COTTON NO 2 (NYB) MAR-14	買建	163	320,705.00	
FROZEN CONCENTRATED ORANGE JUICE (NYB) MAR-14	買建	43	-5,287.50	
GASOLINE RBOB FUT (NYM) FEB-14	買建	40	138,070.80	
GOLD (CMX) FEB-14	買建	37	-431,800.00	
HEATING OIL (NYM) FEB-14	買建	21	21,386.40	
HENRY HUB NATURAL GAS (NYM) FEB-14	買建	117	572,780.00	
LEAN HOGS (CME) FEB-14	買建	42	-96,650.00	
LIGHT SWEET CRUDE OIL (NYM) FEB-14	買建	345	1,655,860.00	
LIVE CATTLE (CME) FEB-14	買建	57	-200.00	
LUMBER (CME) MAR-14	買建	38	44,836.00	
MILK FUTURE (CME) JAN-14	買建	4	12,540.00	
OAT (CBT) MAR-14	買建	46	81,400.00	
PALLADIUM (NYM) MAR-14	買建	6	-26,800.00	
PLATINUM (NYM) APR-14	買建	40	-51,530.00	

ROUGH RICE (CBT) MAR-14	買建	36	-47,360.00	
SILVER (CMX) MAR-14	買建	31	-381,305.00	
SOYBEAN MEAL (CBT) MAR-14	買建	27	35,010.00	
SOYBEAN OIL (CBT) MAR-14	買建	125	-80,526.00	
SOYBEANS (CBT) MAR-14	買建	82	87,612.50	
SUGAR NO 11 WORLD (NYB) MAR-14	買建	79	-55,764.80	
WHEAT (CBT) MAR-14	買建	218	-727,125.00	
WHEAT (KCB) MAR-14	買建	43	-175,637.50	

(注) L M E (ロンドン金属取引所)においては、先渡し売買となるため、期日到来まで反対売買により清算されません。当該取引は売建で表示しております。

ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト

(1) 投資状況 (平成25年12月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	28,429,364,931	99.31
内 日本	28,429,364,931	99.31
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	196,992,084	0.69
純資産総額	28,626,357,015	100.00

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

(注2) 投資資産の内書きの時価および投資比率は、当該資産の地域別の内訳です。

(2) 投資資産 (平成25年12月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	大和住銀FoF用ジャパン・マーケット・ニュートラル	日本	投資信託 受益証券	13,948,653,831	1.0998 15,341,155,926	1.1226 15,658,758,790	54.70
2	ダイワ・トピックス・ニュートラル	日本	投資信託 受益証券	12,293,180,703	1.0327 12,696,098,236	1.0366 12,743,111,116	44.52
3	ベアリングトータルリターン ファンド	日本	投資信託 受益証券	28,319,112	1.0129 28,687,822	0.9709 27,495,025	0.10

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	99.31%
合計	99.31%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 運用実績

純資産の推移

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	4,597,186,157	4,597,186,157	0.9824	0.9824
第2計算期間末 (平成21年6月15日)	4,413,623,564	4,413,623,564	0.9743	0.9743
第3計算期間末 (平成22年6月15日)	7,755,242,332	7,755,242,332	0.9762	0.9762
第4計算期間末 (平成23年6月15日)	9,240,459,060	9,240,459,060	0.9881	0.9881
第5計算期間末 (平成24年6月15日)	9,165,794,017	9,165,794,017	0.9945	0.9945
平成24年12月末日	11,162,166,800	-	0.9859	-
平成25年1月末日	12,960,515,709	-	0.9905	-
2月末日	14,394,303,887	-	0.9958	-
3月末日	15,456,887,801	-	0.9958	-
4月末日	17,209,389,136	-	0.9936	-
5月末日	19,296,615,699	-	0.9917	-
第6計算期間末 (平成25年6月17日)	19,338,978,553	19,338,978,553	0.9847	0.9847
6月末日	19,480,489,511	-	0.9816	-
7月末日	21,072,718,250	-	0.9864	-
8月末日	22,425,799,708	-	0.9884	-
9月末日	24,307,459,602	-	0.9915	-
10月末日	25,844,803,813	-	0.9882	-
11月末日	27,398,427,254	-	0.9896	-
12月末日	28,626,357,015	-	0.9912	-

分配の推移

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
第2計算期間	0.0000
第3計算期間	0.0000
第4計算期間	0.0000
第5計算期間	0.0000
第6計算期間	0.0000
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	-

収益率の推移

	収益率(%)
第1計算期間	1.8
第2計算期間	0.8
第3計算期間	0.2
第4計算期間	1.2
第5計算期間	0.6
第6計算期間	1.0
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	0.4

(4) 設定及び解約の実績

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	4,796,031,209	116,389,801
第2計算期間	2,640,064,910	2,789,641,295
第3計算期間	4,430,585,910	1,016,125,639
第4計算期間	2,696,861,218	1,289,978,628
第5計算期間	1,202,897,883	1,337,482,900
第6計算期間	12,442,404,395	2,018,935,284
平成25年6月18日～ 平成25年12月17日	11,025,036,370	2,120,230,528

(注) 当初設定数量は100,000口です。

[次へ](#)

(参考情報)

ダイワファンドラップ 日本株式セレクト

2013年12月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,779円
純資産総額	677億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.3%
3カ月間	6.6%
6カ月間	23.9%
1年間	70.1%
3年間	78.3%
5年間	98.5%
設定来	7.8%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期			
	08年6月	09年6月	10年6月	11年6月	12年6月	13年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

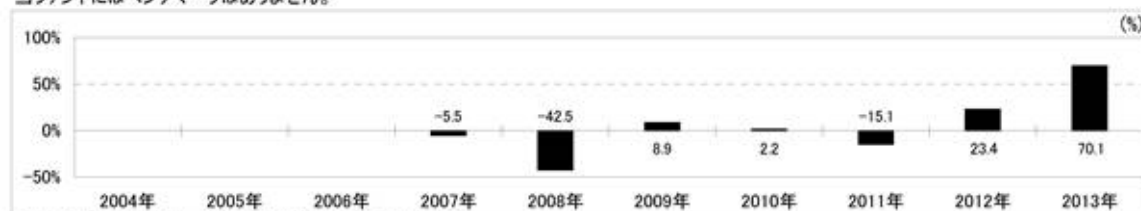
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
シンプレクス・アセット・マネジメント	J Flag スモールキャップ・ファンド	25.3%
JPモルガン・アセット・マネジメント	JPM日本株・ファンド	24.4%
大和証券投資信託委託	ダイワ好配当日本株投信Q	19.9%
大和証券投資信託委託	ダイワ・パリュール株・オープン	14.9%
シンプレクス・アセット・マネジメント	スピリタス・ディスティレーション・ファンド	14.8%
合計		99.3%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2007年は設定日(11月1日)から年末、2013年は12月30日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

ダイワファンドラップ 日本債券セレクト

2013年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額	10,837円
純資産総額	918億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.4%
3カ月間	0.2%
6カ月間	1.3%
1年間	1.6%
3年間	4.5%
5年間	7.9%
設定来	8.4%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 08年6月	第2期 09年6月	第3期 10年6月	第4期 11年6月	第5期 12年6月	第6期 13年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

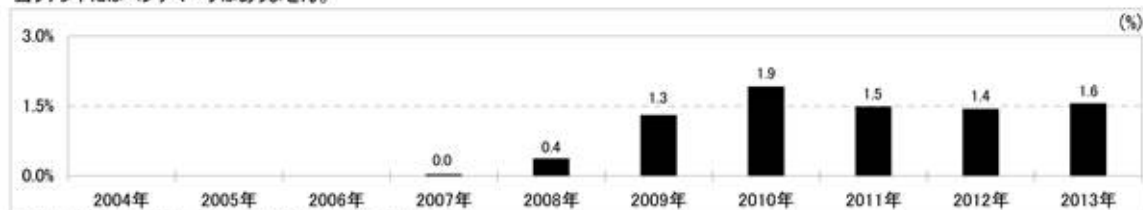
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
シンプレクス・アセット・マネジメント	みずほ信 クレジットアクティブ・ファンド	39.7%
東京海上アセットマネジメント投信	東京海上日本債ファンドM	29.8%
マンユライフ・インベストメンツ・ジャパン	マンユライフ日本債券アクティブ・ファンドM	24.8%
大和証券投資信託委託	ダイワ日本国債ファンド	5.0%
合計		99.3%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2007年は設定日(11月1日)から年末、2013年は12月30日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

ダイワファンドラップ 外国株式セレクト

2013年12月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,989円
純資産総額	341億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.6%
3カ月間	13.5%
6カ月間	24.2%
1年間	50.6%
3年間	72.1%
5年間	127.9%
設定来	-0.1%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期			
	08年6月	09年6月	10年6月	11年6月	12年6月	13年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

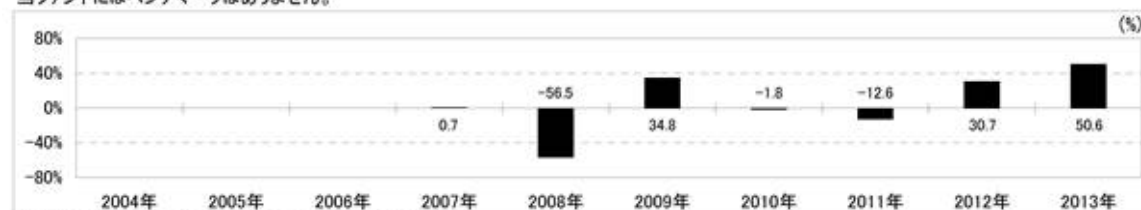
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
MFSインベストメント・マネジメント	MFS外国株コア・ファンド	47.0%
ロベコ・インスティテューショナル・アセット・マネジメント・ビーヴィー	ロベコ・US・プレミアム・エクイティーズI USDシェアーズ	27.5%
大和証券投資信託委託	ダイワ海外好配当株ファンドM	15.0%
アイエヌジー・アセット・マネジメントB.V.	ING(L)インベスト・ヨーロッパ・オポチュニティーズ	8.6%
合計		98.0%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2007年は設定日(11月1日)から年末、2013年は12月30日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

ダイワファンドラップ 外国株式セレクト エマージングプラス

2013年12月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,592円
純資産総額	471億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.2%
3カ月間	12.1%
6カ月間	23.2%
1年間	43.9%
3年間	59.0%
5年間	126.0%
設定来	-4.1%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期			
	08年6月	09年6月	10年6月	11年6月	12年6月	13年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

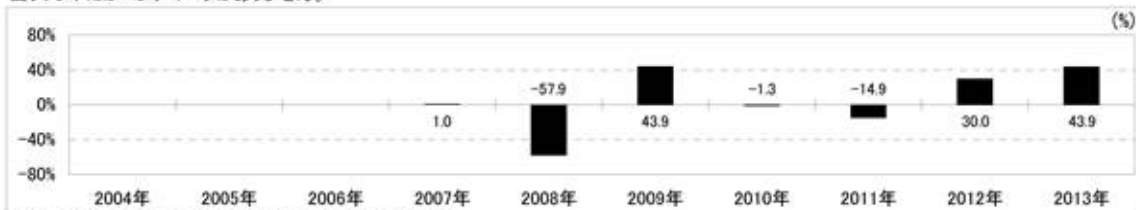
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
MFSインベストメント・マネジメント	MFS外国株コア・ファンド	37.4%
ロベコ・インスティテューショナル・アセット・マネジメント・ビーヴィー	ロベコ・US・プレミアム・エクイティーズI USDシェアーズ	24.6%
ラザード・アセット・マネジメントLLC	ラザード・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド	13.2%
大和証券投資信託委託	ダイワ海外好配当株ファンドM	11.8%
アイエヌジー・アセット・マネジメントB.V.	ING(L)インベスト・ヨーロッパ・オポチュニティーズ	6.3%
UBS グローバル・アセット・マネジメント	UBS BRIC _s プラス・ファンド	5.8%
合計		99.0%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2007年は設定日(11月1日)から年末、2013年は12月30日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

ダイワファンドラップ 外国債券セレクト

2013年12月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,100円
純資産総額	239億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.7%
3カ月間	6.8%
6カ月間	10.0%
1年間	20.1%
3年間	41.3%
5年間	29.9%
設定来	11.0%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期			
	08年6月	09年6月	10年6月	11年6月	12年6月	13年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

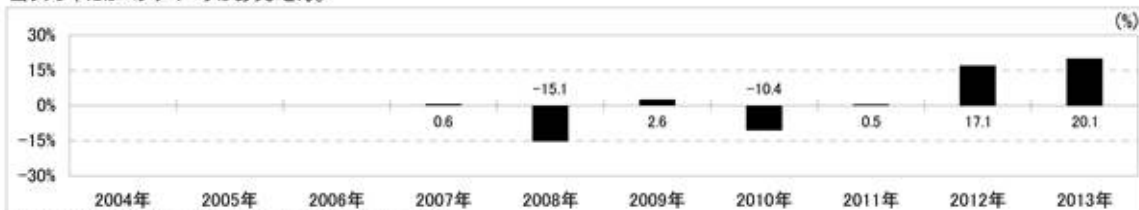
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー	ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ(ケイマン)グローバル総合債券(除く日本)クラスB	29.7%
ベアリング投信投資顧問	ベアリング外国債券ファンドM	29.5%
ブラックロック・ジャパン	ブラックロック外国債券ファンドM	24.6%
モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント	モルガン・スタンレー・グローバル・ボンド・オープンM	14.7%
合計		98.6%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2007年は設定日(11月1日)から年末、2013年は12月30日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

ダイワファンドラップ 外国債券セレクト エマージングプラス

2013年12月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,499円
純資産総額	200億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.9%
3カ月間	6.7%
6カ月間	10.2%
1年間	19.3%
3年間	42.6%
5年間	41.1%
設定来	15.0%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 08年6月	第2期 09年6月	第3期 10年6月	第4期 11年6月	第5期 12年6月	第6期 13年6月				
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円				

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

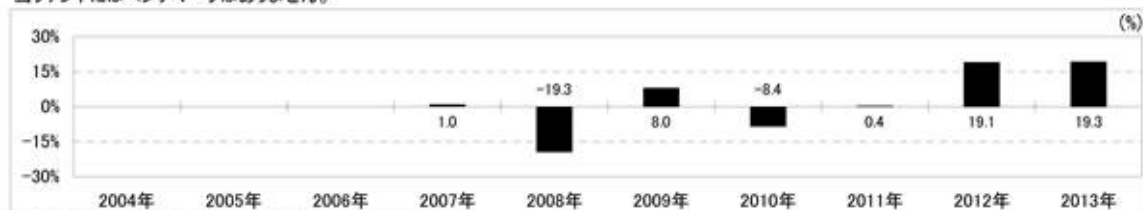
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー	ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ(ケイマン)グローバル総合債券(除く日本)クラスB	24.1%
ベアリング投信投資顧問	ベアリング外国債券ファンドM	23.7%
ブラックロック・ジャパン	ブラックロック外国債券ファンドM	19.7%
大和住銀投信投資顧問	T. ロウ・プライス新興国債券オープンM	12.9%
モルガン・スタンレー・インバーストメント・マネジメント	モルガン・スタンレー・グローバル・ボンド・オープンM	11.8%
ブラックロック・ジャパン	ブラックロック・エマージング・ボンド・ファンドM	6.9%
合計		99.1%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2007年は設定日(11月1日)から年末、2013年は12月30日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

ダイワファンドラップ J-REITセレクト

2013年12月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	12,085円
純資産総額	208億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	4.3%
3カ月間	2.4%
6カ月間	11.3%
1年間	42.7%
3年間	58.7%
5年間	116.0%
設定来	20.9%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期				
	08年6月	09年6月	10年6月	11年6月	12年6月	13年6月				
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円				

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

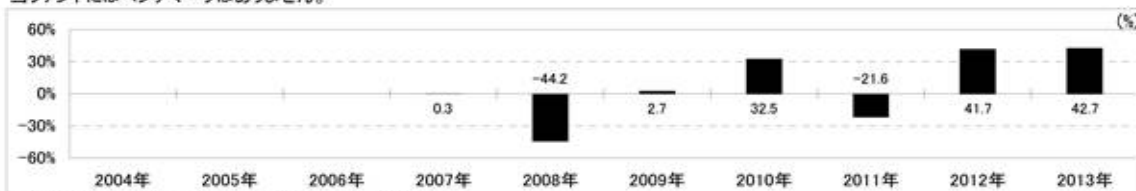
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	リート用途別構成	比率	租入上位10銘柄	用途名	比率
国内リート	42	97.8%	オフィス不動産	35.1%	日本ビルファンド	オフィス不動産	10.9%
			各種不動産	21.8%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産	8.1%
			店舗用不動産	14.1%	日本リテールファンド	店舗用不動産	6.3%
			工業用不動産	12.8%	ユナイテッド・アーバン投資法人	各種不動産	5.9%
			住宅用不動産	9.4%	フロンティア不動産投資	店舗用不動産	4.5%
			専門不動産	4.7%	日本プロロジスリート	工業用不動産	4.3%
					森ヒルズリート	オフィス不動産	4.2%
					アドバンス・レジデンス	住宅用不動産	3.9%
					ジャパン・ホテル・リート投資法人	専門不動産	3.2%
コール・ローン、その他		2.2%			日本ロジスティクスファンド投資法人	工業用不動産	3.2%
合計	42	100.0%	合計	97.8%	合計		54.6%

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&PとMSCI Incが共同で作成した世界産業分類基準(GICS)によるものです。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2007年は設定日(11月1日)から年末、2013年は12月30日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

ダイワファンドラップ 外国REITセレクト

2013年12月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,326円
純資産総額	151億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	2.2%
3カ月間	6.6%
6カ月間	6.6%
1年間	24.1%
3年間	62.1%
5年間	144.2%
設定来	3.3%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期			
	08年6月	09年6月	10年6月	11年6月	12年6月	13年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

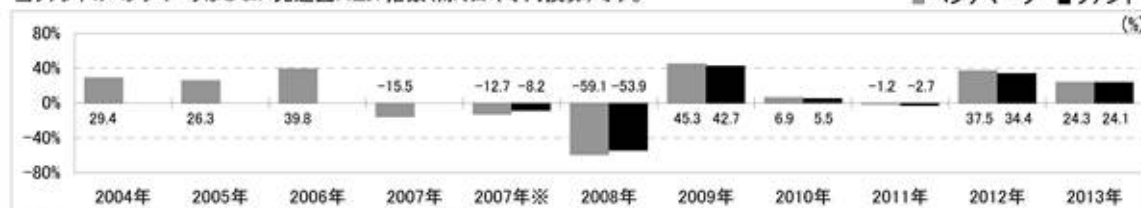
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	紹介上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート	79	96.2%	米ドル	65.7%	商業施設	33.4%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	8.9%
			豪ドル	11.3%	分散投資	14.2%	VORNADO REALTY TRUST	分散投資	アメリカ	3.7%
			英ポンド	9.5%	オフィス	12.0%	LAND SECURITIES GROUP PLC	商業施設	イギリス	3.2%
			ユーロ	7.0%	住宅施設	10.3%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	3.2%
合計	79	100.0%	シンガポール・ドル	2.3%	産業施設	8.0%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅施設	アメリカ	3.1%
国・地域別構成			香港ドル	1.7%	医療施設	7.4%	BOSTON PROPERTIES INC	オフィス	アメリカ	2.8%
アメリカ		64.2%	カナダ・ドル	1.5%	個人用倉庫	5.1%	VENTAS INC	医療施設	アメリカ	2.7%
オーストラリア		10.7%	日本円	1.1%	ホテル/リゾート	4.8%	SL GREEN REALTY CORP	オフィス	アメリカ	2.5%
イギリス		9.3%			その他	1.0%	UNIBAIL-RODAMCO SE	商業施設	フランス	2.4%
フランス		4.2%					UDR INC	住宅施設	アメリカ	2.2%
その他		7.8%								
合計		96.2%	合計	100.0%	合計	96.2%	合計			34.6%

※リート用途別構成の用途は、原則としてS&P Global Property Indexの分類によるものです。なお、優先リート(会社が発行する優先株に相当するリート)は、用途別の分類はしていません。

年間収益率の推移

当ファンドのベンチマークはS&P先進国REIT指数(除く日本、円換算)です。

■ベンチマーク ■ファンド



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2007年※は設定日(11月1日)から年末、2013年は12月30日までの騰落率を表しています。

・当該ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績を表したものではありません。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

ダイワファンドラップ コモディティセレクト

2013年12月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	6,741円
純資産総額	151億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	5.1%
3カ月間	6.3%
6カ月間	9.8%
1年間	15.6%
3年間	14.3%
5年間	55.1%
設定来	-29.7%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 500円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期			
	08年6月	09年6月	10年6月	11年6月	12年6月	13年6月			
分配金	500円	0円	0円	0円	0円	0円			

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

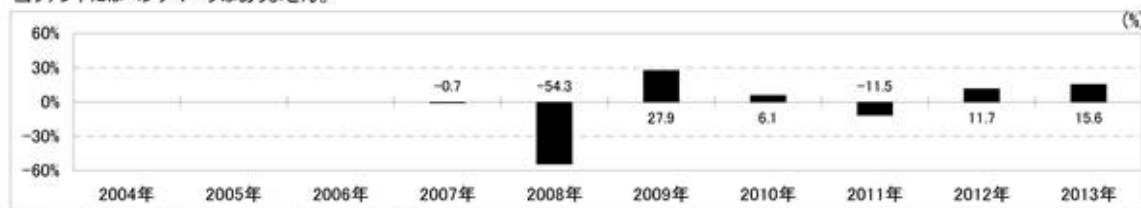
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
ダイワ・アセット・マネジメント(シンガポール)リミテッド	ダイワ"RICI"ファンド	98.6%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネー・マザーファンド	0.2%
合計		98.7%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2007年は設定日(11月1日)から年末、2013年は12月30日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト

2013年12月30日現在

※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,912円
純資産総額	286億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.2%
3カ月間	-0.0%
6カ月間	1.0%
1年間	0.5%
3年間	1.6%
5年間	2.6%
設定来	-0.9%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期 08年6月	第2期 09年6月	第3期 10年6月	第4期 11年6月	第5期 12年6月	第6期 13年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

※分配金は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

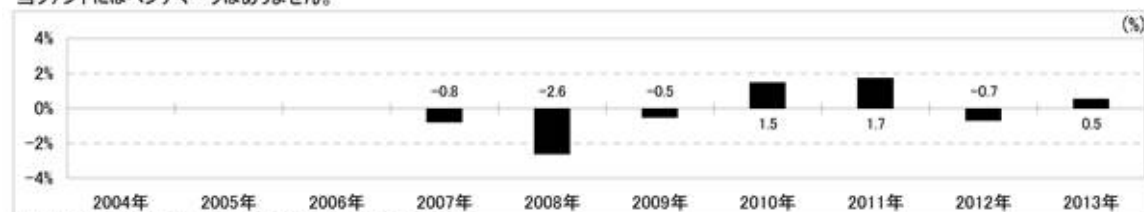
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
大和住銀投信投資顧問	大和住銀FoF用ジャパン・マーケット・ニュートラル	54.7%
大和証券投資信託委託	ダイワ・トピックス・ニュートラル	44.5%
ペアリング投信投資顧問	ペアリング トータルリターン ファンド	0.1%
合計		99.3%

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。
・2007年は設定日(11月1日)から年末、2013年は12月30日までの騰落率を表しています。

最新の運用実績は、委託会社のホームページ、または販売会社でご確認いただけます。

ダイワファンドラップ 日本株式セレクト

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

ダイワファンドラップ 日本株式セレクト

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		952,716,843
投資信託受益証券		62,286,283,611
流動資産合計		63,239,000,454
資産合計		63,239,000,454
負債の部		
流動負債		
未払解約金		268,692,127
未払受託者報酬		10,832,289
未払委託者報酬		108,323,347
その他未払費用		1,078,166
流動負債合計		388,925,929
負債合計		388,925,929
純資産の部		
元本等		
元本	1	61,473,644,780
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,376,429,745
（分配準備積立金）		6,368,545,505
元本等合計		62,850,074,525
純資産合計		62,850,074,525
負債純資産合計		63,239,000,454

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日 金額(円)
営業収益	
受取配当金	237,980,267
受取利息	280,455
有価証券売買等損益	7,424,541,017
営業収益合計	7,662,801,739
営業費用	
受託者報酬	10,832,289
委託者報酬	108,323,347
その他費用	1,078,166
営業費用合計	120,233,802
営業利益	7,542,567,937
経常利益	7,542,567,937
中間純利益	7,542,567,937
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	744,199,695
期首剰余金又は期首欠損金()	5,762,534,246
剰余金増加額又は欠損金減少額	870,067,006
中間一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	870,067,006
剰余金減少額又は欠損金増加額	529,471,257
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	529,471,257
中間剰余金又は中間欠損金()	1,376,429,745

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 1 期首元本額	43,410,852,125円
期中追加設定元本額	25,887,090,779円
期中一部解約元本額	7,824,298,124円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	61,473,644,780口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0224円 (10,224円)

[次へ](#)

ダイワファンドラップ 日本債券セレクト

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

ダイワファンドラップ 日本債券セレクト

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,307,606,204
投資信託受益証券		89,461,645,853
流動資産合計		90,769,252,057
資産合計		90,769,252,057
負債の部		
流動負債		
未払解約金		270,833,646
未払受託者報酬		15,015,480
未払委託者報酬		150,155,283
その他未払費用		1,068,560
流動負債合計		437,072,969
負債合計		437,072,969
純資産の部		
元本等		
元本	1	83,312,848,675
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		7,019,330,413
（分配準備積立金）		837,185,670
元本等合計		90,332,179,088
純資産合計		90,332,179,088
負債純資産合計		90,769,252,057

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日 金額(円)
営業収益	
受取配当金	129,958,875
受取利息	382,264
有価証券売買等損益	893,714,907
営業収益合計	1,024,056,046
営業費用	
受託者報酬	15,015,480
委託者報酬	150,155,283
その他費用	1,068,560
営業費用合計	166,239,323
営業利益	857,816,723
経常利益	857,816,723
中間純利益	857,816,723
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	50,404,298
期首剰余金又は期首欠損金()	3,677,989,036
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,972,021,076
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	2,972,021,076
剰余金減少額又は欠損金増加額	438,092,124
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	438,092,124
中間剰余金又は中間欠損金()	7,019,330,413

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成25年6月18日	至 平成25年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。	

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
1. 1期首元本額	52,257,782,943円	
期中追加設定元本額	37,133,911,326円	
期中一部解約元本額	6,078,845,594円	
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	83,312,848,675口	

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間	
	自 平成25年6月18日	至 平成25年12月17日
	該当事項はありません。	

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
該当事項はありません。	

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0843円 (10,843円)

[次へ](#)

ダイワファンドラップ 外国株式セレクト

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

ダイワファンドラップ 外国株式セレクト

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		113,464,000
コール・ローン		496,639,618
投資信託受益証券		19,919,126,437
投資証券		11,533,338,726
流動資産合計		32,062,568,781
資産合計		32,062,568,781
負債の部		
流動負債		
未払金		113,464,000
未払解約金		138,326,732
未払受託者報酬		5,065,346
未払委託者報酬		50,653,805
その他未払費用		941,427
流動負債合計		308,451,310
負債合計		308,451,310
純資産の部		
元本等		
元本	1	33,732,073,213
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2	1,977,955,742
（分配準備積立金）		2,542,783,333
元本等合計		31,754,117,471
純資産合計		31,754,117,471
負債純資産合計		32,062,568,781

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日 金額(円)
営業収益	
受取配当金	115,776,462
受取利息	192,642
有価証券売買等損益	2,992,121,904
為替差損益	717,020,531
営業収益合計	3,825,111,539
営業費用	
受託者報酬	5,065,346
委託者報酬	50,653,805
その他費用	1,242,667
営業費用合計	56,961,818
営業利益	3,768,149,721
経常利益	3,768,149,721
中間純利益	3,768,149,721
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	291,494,536
期首剰余金又は期首欠損金()	4,135,549,974
剰余金増加額又は欠損金減少額	661,092,373
中間一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	661,092,373
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,980,153,326
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,980,153,326
中間剰余金又は中間欠損金()	1,977,955,742

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 1期首元本額	20,853,003,316円
期中追加設定元本額	16,606,367,785円
期中一部解約元本額	3,727,297,888円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	33,732,073,213口
3. 2元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,977,955,742円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9414円 (9,414円)

[次へ](#)

ダイワファンドラップ 外国株式セレクト エマージングプラス

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

ダイワファンドラップ 外国株式セレクト エマージングプラス

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		6,987,958
コール・ローン		689,909,629
投資信託受益証券		24,512,886,697
投資証券		19,637,649,306
未収入金		24,000,000
流動資産合計		44,871,433,590
資産合計		44,871,433,590
負債の部		
流動負債		
未払解約金		223,825,474
未払受託者報酬		8,244,090
未払委託者報酬		82,441,274
その他未払費用		1,067,252
流動負債合計		315,578,090
負債合計		315,578,090
純資産の部		
元本等		
元本	1	49,079,917,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2	4,524,061,500
（分配準備積立金）		4,036,695,339
元本等合計		44,555,855,500
純資産合計		44,555,855,500
負債純資産合計		44,871,433,590

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日 金額(円)
営業収益	
受取配当金	228,563,337
受取利息	242,594
有価証券売買等損益	4,472,840,928
為替差損益	1,357,857,469
営業収益合計	6,059,504,328
営業費用	
受託者報酬	8,244,090
委託者報酬	82,441,274
その他費用	1,368,492
営業費用合計	92,053,856
営業利益	5,967,450,472
経常利益	5,967,450,472
中間純利益	5,967,450,472
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	509,424,521
期首剰余金又は期首欠損金()	9,358,249,838
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,378,058,393
中間一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,378,058,393
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,001,896,006
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	2,001,896,006
中間剰余金又は中間欠損金()	4,524,061,500

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 (2)投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資法人が発行する投資証券の1口当たり純資産額に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。
4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	41,974,828,565円 13,565,682,638円 6,460,594,203円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	49,079,917,000口
3. 2 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,524,061,500円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 平成25年12月17日 現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9078円 (9,078円)

[次へ](#)

ダイワファンドラップ 外国債券セレクト

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

ダイワファンドラップ 外国債券セレクト

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		479,574,029
投資信託受益証券		22,787,199,850
流動資産合計		23,266,773,879
資産合計		23,266,773,879
負債の部		
流動負債		
未払解約金		75,065,852
未払受託者報酬		3,687,025
未払委託者報酬		36,870,671
その他未払費用		691,223
流動負債合計		116,314,771
負債合計		116,314,771
純資産の部		
元本等		
元本	1	21,145,469,961
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		2,004,989,147
（分配準備積立金）		895,073,912
元本等合計		23,150,459,108
純資産合計		23,150,459,108
負債純資産合計		23,266,773,879

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日 金額(円)
営業収益	
受取配当金	299,708,441
受取利息	147,116
有価証券売買等損益	1,361,030,260
営業収益合計	1,660,885,817
営業費用	
受託者報酬	3,687,025
委託者報酬	36,870,671
その他費用	691,223
営業費用合計	41,248,919
営業利益	1,619,636,898
経常利益	1,619,636,898
中間純利益	1,619,636,898
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	50,245,777
期首剰余金又は期首欠損金()	64,661,036
剰余金増加額又は欠損金減少額	389,307,808
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	389,307,808
剰余金減少額又は欠損金増加額	18,370,818
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	18,370,818
中間剰余金又は中間欠損金()	2,004,989,147

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 1 期首元本額	13,024,524,537円
期中追加設定元本額	9,553,018,896円
期中一部解約元本額	1,432,073,472円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	21,145,469,961口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0948円 (10,948円)

[次へ](#)

ダイワファンドラップ 外国債券セレクト エマージングプラス

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

ダイワファンドラップ 外国債券セレクト エマージングプラス

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		302,635,507
投資信託受益証券		19,475,581,394
未収入金		37,000,000
流動資産合計		19,815,216,901
資産合計		19,815,216,901
負債の部		
流動負債		
未払解約金		95,137,184
未払受託者報酬		3,602,256
未払委託者報酬		36,023,011
その他未払費用		675,327
流動負債合計		135,437,778
負債合計		135,437,778
純資産の部		
元本等		
元本	1	17,377,577,070
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		2,302,202,053
（分配準備積立金）		1,208,670,580
元本等合計		19,679,779,123
純資産合計		19,679,779,123
負債純資産合計		19,815,216,901

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日 金額(円)
営業収益	
受取配当金	318,681,687
受取利息	112,038
有価証券売買等損益	1,194,925,802
営業収益合計	1,513,719,527
営業費用	
受託者報酬	3,602,256
委託者報酬	36,023,011
その他費用	675,327
営業費用合計	40,300,594
営業利益	1,473,418,933
経常利益	1,473,418,933
中間純利益	1,473,418,933
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	67,225,905
期首剰余金又は期首欠損金()	596,875,830
剰余金増加額又は欠損金減少額	384,684,888
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	384,684,888
剰余金減少額又は欠損金増加額	85,551,693
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	85,551,693
中間剰余金又は中間欠損金()	2,302,202,053

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 1期首元本額	14,270,635,177円
期中追加設定元本額	4,946,672,301円
期中一部解約元本額	1,839,730,408円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	17,377,577,070口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1325円 (11,325円)

[次へ](#)

ダイワファンドラップ J-REITセレクト

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

ダイワファンドラップ J-REITセレクト

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		124,969,866
親投資信託受益証券		19,365,314,796
流動資産合計		19,490,284,662
資産合計		19,490,284,662
負債の部		
流動負債		
未払解約金		60,512,979
未払受託者報酬		3,451,221
未払委託者報酬		51,769,069
その他未払費用		431,318
流動負債合計		116,164,587
負債合計		116,164,587
純資産の部		
元本等		
元本	1	17,117,428,172
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		2,256,691,903
（分配準備積立金）		1,601,940,539
元本等合計		19,374,120,075
純資産合計		19,374,120,075
負債純資産合計		19,490,284,662

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日 金額(円)
営業収益	
受取利息	21,279
有価証券売買等損益	1,731,963,031
営業収益合計	1,731,984,310
営業費用	
受託者報酬	3,451,221
委託者報酬	51,769,069
その他費用	431,318
営業費用合計	55,651,608
営業利益	1,676,332,702
経常利益	1,676,332,702
中間純利益	1,676,332,702
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	166,132,171
期首剰余金又は期首欠損金()	94,618,697
剰余金増加額又は欠損金減少額	705,192,731
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	705,192,731
剰余金減少額又は欠損金増加額	53,320,056
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	53,320,056
中間剰余金又は中間欠損金()	2,256,691,903

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 1期首元本額	11,581,549,631円
期中追加設定元本額	7,364,964,183円
期中一部解約元本額	1,829,085,642円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	17,117,428,172口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1口当たり純資産額	1.1318円

(1万口当たり純資産額)	(11,318円)
--------------	-----------

(参考)

当ファンドは、「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

[次へ](#)

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成25年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		198,802,629
投資証券		25,864,258,000
未収入金		47,006,080
未収配当金		117,909,100
流動資産合計		26,227,975,809
資産合計		26,227,975,809
負債の部		
流動負債		
未払金		64,721,544
未払解約金		17,300,000
流動負債合計		82,021,544
負債合計		82,021,544
純資産の部		
元本等		
元本	1	16,055,252,001
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		10,090,702,264
元本等合計		26,145,954,265
純資産合計		26,145,954,265
負債純資産合計		26,227,975,809

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成25年12月17日現在
1. 1期首	平成25年6月18日
期首元本額	11,893,919,135円
期中追加設定元本額	4,799,224,775円
期中一部解約元本額	637,891,909円
期末元本額の内訳	

ファンド名	
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	51,427,300円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	59,525,904円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	274,501,305円
6資産バランスファンド（分配型）	423,989,529円
6資産バランスファンド（成長型）	786,313,760円
ダイワ三資産分散ファンド（インカム&キャッシュ、外債、内外リート）（隔月分配型）	51,620,935円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	194,923,213円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	6,753,734円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	186,957,725円
ワールドアセット（安定コース）	111,308円
ワールドアセット（分散コース）	124,302円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	154,579,738円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	184,508,275円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	174,476,669円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	288,435,931円
ダイワファンドラップ J-REIT セレクト	11,891,504,327円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（成長型）	328,408,599円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（安定型）	108,494,347円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（分配型）	491,445,420円
ダイワJリート・ファンド	397,149,680円
計	16,055,252,001円
2. 期末日における受益権の総数	16,055,252,001口

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成25年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成25年12月17日現在

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成25年12月17日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6285円 (16,285円)
---------------------------	----------------------

[次へ](#)

ダイワファンドラップ 外国REITセレクト

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

ダイワファンドラップ 外国REITセレクト

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		202,023,562
親投資信託受益証券		14,320,982,169
流動資産合計		14,523,005,731
資産合計		14,523,005,731
負債の部		
流動負債		
未払解約金		69,726,900
未払受託者報酬		2,591,225
未払委託者報酬		55,064,398
その他未払費用		323,817
流動負債合計		127,706,340
負債合計		127,706,340
純資産の部		
元本等		
元本	1	14,530,804,950
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2	135,505,559
（分配準備積立金）		2,071,508,214
元本等合計		14,395,299,391
純資産合計		14,395,299,391
負債純資産合計		14,523,005,731

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間	
	自 平成25年6月18日	至 平成25年12月17日
	金額(円)	
営業収益		
受取利息		33,767
有価証券売買等損益		551,234,027
営業収益合計		551,267,794
営業費用		
受託者報酬		2,591,225
委託者報酬	1	55,064,398
その他費用		323,817
営業費用合計		57,979,440
営業利益		493,288,354
経常利益		493,288,354
中間純利益		493,288,354
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額		40,339,462
期首剰余金又は期首欠損金()		547,963,470
剰余金増加額又は欠損金減少額		56,920,913
中間一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額		56,920,913
剰余金減少額又は欠損金増加額		97,411,894
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額		97,411,894
中間剰余金又は中間欠損金()		135,505,559

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 1期首元本額	10,532,754,915円
期中追加設定元本額	5,246,142,509円
期中一部解約元本額	1,248,092,474円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	14,530,804,950口
3. 2元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は135,505,559円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
1 投資信託財産(親投資信託)の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	35,116,133円

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9907円 (9,907円)

（参考）

当ファンドは、「ダイワ海外REIT・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

[次へ](#)

「ダイワ海外REIT・マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成25年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		362,141,914
コール・ローン		127,502,788
投資証券		14,220,802,088
未収入金		6,561,401
未収配当金		25,501,557
流動資産合計		14,742,509,748
資産合計		14,742,509,748
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		4,950
未払解約金		3,000,000
流動負債合計		3,004,950
負債合計		3,004,950
純資産の部		
元本等		
元本	1	15,289,966,114
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	550,461,316
元本等合計		14,739,504,798
純資産合計		14,739,504,798
負債純資産合計		14,742,509,748

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「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）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
----------------------------	--

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成25年12月17日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額 期末元本額の内訳 ファンド名 ダイワファンドラップ 外国 REITセレクト ライフハーモニー（ダイワ世界 資産分散ファンド）（成長型） ライフハーモニー（ダイワ世界 資産分散ファンド）（安定型） 計	平成25年6月18日 11,228,155,103円 4,079,793,964円 17,982,953円 14,855,790,632円 326,808,247円 107,367,235円 15,289,966,114円
2. 期末日における受益権の総数	15,289,966,114口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は550,461,316円であります。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成25年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。 (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成25年12月17日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	56,720,950	-	56,716,000	4,950
アメリカ・ドル	56,720,950	-	56,716,000	4,950
合計	56,720,950	-	56,716,000	4,950

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買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。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買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。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値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。

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの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。
- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買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売買相場の仲値を用いております。

(2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成25年12月17日現在
1口当たり純資産額	0.9640円
(1万口当たり純資産額)	(9,640円)

[次へ](#)

ダイワファンドラップ コモディティセレクト

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

ダイワファンドラップ コモディティセレクト

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		138
コール・ローン		192,856,283
投資信託受益証券		14,438,434,572
親投資信託受益証券		24,318,667
流動資産合計		14,655,609,660
資産合計		14,655,609,660
負債の部		
流動負債		
未払解約金		97,862,476
未払受託者報酬		2,546,498
未払委託者報酬		19,099,010
その他未払費用		477,386
流動負債合計		119,985,370
負債合計		119,985,370
純資産の部		
元本等		
元本	1	22,285,382,948
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2	7,749,758,658
（分配準備積立金）		109,246,203
元本等合計		14,535,624,290
純資産合計		14,535,624,290
負債純資産合計		14,655,609,660

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日 金額(円)
営業収益	
受取利息	67,950
有価証券売買等損益	196,860,451
為替差損益	1,016,671,690
営業収益合計	819,879,189
営業費用	
受託者報酬	2,546,498
委託者報酬	19,099,010
その他費用	717,973
営業費用合計	22,363,481
営業利益	797,515,708
経常利益	797,515,708
中間純利益	797,515,708
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	46,541,495
期首剰余金又は期首欠損金()	6,198,281,356
剰余金増加額又は欠損金減少額	770,784,996
中間一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	770,784,996
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,073,236,511
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,073,236,511
中間剰余金又は中間欠損金()	7,749,758,658

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 1 期首元本額	15,800,147,422円
期中追加設定元本額	8,485,326,871円
期中一部解約元本額	2,000,091,345円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	22,285,382,948口
3. 2 元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は7,749,758,658円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日

	該当事項はありません。
--	-------------

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.6522円 (6,522円)

(参考)

当ファンドは、「ダイワ・マネー・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、ケイマン籍の外国投資信託「ダイワ “ RICI ” ファンド」受益証券(米ドル建)を主要投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

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

[次へ](#)

「ダイワ・マネー・マザーファンド」の状況
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成25年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		5,121,819,142
国債証券		8,799,199,164
流動資産合計		13,921,018,306
資産合計		13,921,018,306
負債の部		
流動負債		
流動負債合計		-
負債合計		-
純資産の部		
元本等		
元本	1	13,660,921,100
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		260,097,206
元本等合計		13,921,018,306
純資産合計		13,921,018,306
負債純資産合計		13,921,018,306

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成25年12月17日現在
1. 1 期首	平成25年6月18日
期首元本額	9,485,280,241円
期中追加設定元本額	12,287,617,199円
期中一部解約元本額	8,111,976,340円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
ダイワ/“RICI@”コモ	28,569,968円
ディティ・ファンド	
US債券NB戦略ファンド（為替ヘッジあり/年1回決算型）	4,909円
US債券NB戦略ファンド（為替ヘッジなし/年1回決算型）	4,909円

ダイワファンドラップ コモ ディティセレクト	23,865,228円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプルリ ターンズ - 日本円・コース (毎月分配型)	132,757円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプルリ ターンズ - 豪ドル・コース (毎月分配型)	643,132円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプルリ ターンズ - ブラジル・レア ル・コース(毎月分配型)	4,401,613円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプルリ ターンズ - 米ドル・コース (毎月分配型)	12,784円
ダイワノフィデリティ北米株式 ファンド - パラダイムシフト -	49,096,623円
ダイワ・コモディティインデッ クス・ファンド(ジム・ロ ジャーズ世界探検記)	10,780,649円
ダイワFEグローバル・バ リュウ株ファンド(ダイワSM A専用)	27,634,047円
ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型)ブラジル・レア ル・コース(毎月分配型)	98,290,744円
ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型)日本円・コース (毎月分配型)	23,590,527円
ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型)米ドル・コース (毎月分配型)	2,163,360円
ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型)豪ドル・コース (毎月分配型)	13,761,552円
ダイワノUBSエマージングC Bファンド	4,951,720円
ダイワノアムンディ食糧増産関 連ファンド	24,591,777円
ダイワ日本リート・ファンド・ マネー・ポートフォリオ	85,161,209円
ダイワ新興国ハイインカム・ブ ラス - 金積立型 -	11,784,347円
ダイワ新興国ハイインカム債券 ファンド(償還条項付き)為替 ヘッジあり	23,568,693円
ダイワ新興国ハイインカム債券 ファンド(償還条項付き)為替 ヘッジなし	26,514,780円
ダイワ・インフラビジネス・ ファンド - インフラ革命 - (為替ヘッジあり)	9,813,543円
ダイワ・インフラビジネス・ ファンド - インフラ革命 - (為替ヘッジなし)	29,440,629円

ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型)南アフリカ・ラ ンド・コース(毎月分配型)	98,252円
ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型)トルコ・リラ・ コース(毎月分配型)	2,554,212円
ダイワ米国高金利社債ファンド (通貨選択型)通貨セレクト・ コース(毎月分配型)	1,178,976円
ダイワ・オーストラリア高配当 株(毎月分配型)株式 コース	98,203円
ダイワ・オーストラリア高配当 株(毎月分配型)通貨 コース	98,203円
ダイワ・オーストラリア高配当 株(毎月分配型)株式&通 貨ツイン コース	982,029円
ブルベア・マネー・ポートフォ リオ	13,157,033,551円
ダイワ米国株ストラテジー (通貨選択型) - トリプルリ ターンズ - 通貨セレクト・コ ース(毎月分配型)	98,174円
計	13,660,921,100円
2. 期末日における受益権の総数	13,660,921,100口

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成25年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成25年12月17日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成25年12月17日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0190円 (10,190円)

[次へ](#)

「Daiwa “ RICI ” Fund」の状況

「Daiwa “ RICI ” Fund」は、ケイマン籍の外国投資信託の受益証券（米ドル建）であります。同ファンドは平成25年4月30日に計算期間が終了し、作成された財務諸表は独立監査人により国際監査基準（ISA）に準拠した監査を受けております。以下に記載した同ファンドの情報は、監査済み財務諸表を委託会社で抜粋・翻訳したものです。

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

ダイワ “ RICI ” ファンド

アニュアルレポート および 監査済み財務諸表

2013年4月30日に終了した会計年度

財政状態計算書 2013年4月30日現在

	注記	2013年 米ドル	2012年 米ドル
資産			
現金	5	4,190,783	7,486,512
証拠金	5	33,524,754	21,176,131
受取勘定	6	139	202
公正価額評価損益通算金融資産	2,3,4	73,944,278	64,597,631
資産合計		111,659,954	93,260,476
資本			
受益証券元本		94,586,670	63,564,693
剰余金		12,887,019	19,244,353
資本合計	8,14	107,473,689	82,809,046
負債			
未払証拠金	5	310,454	151,912

支払勘定 - 1年以内に支払期限が到来するもの	7	109,077	8,095,800
公正価額評価損益通算金融負債	2,3,4	3,766,734	2,203,718
負債合計		4,186,265	10,451,430
資本および負債合計		111,659,954	93,260,476

添付の注記および組入資産の明細は、財務諸表の不可欠な一部を構成します。
受託会社の代表が署名しました。

Conor Curtin

Sara Kinsella

日付: 2013年10月29日

包括利益計算書
2013年4月30日に終了した会計年度

	注記	2013年 米ドル	2012年 米ドル
収入			
利息収入		3,360	2,656
公正価額評価損益通算金融資産および負債による純損失	11	(5,323,336)	(14,945,020)
純投資損失合計		(5,319,976)	(14,942,364)
費用			
運用会社報酬	9	706,868	724,129
管理報酬	9	128,527	131,655
受託会社報酬	9	8,568	8,779
カストディフィー	9	12,852	13,167
仲介手数料		135,792	107,180
監査費用		28,900	28,604
その他の費用		8,349	6,694
費用合計		1,029,856	1,020,208
営業損失		(6,349,832)	(15,962,572)
金融費用			
支払利息		(7,502)	(10,519)

金融費用合計	(7,502)	(10,519)
包括利益合計	(6,357,334)	(15,973,091)

損益は継続事業によるもののみとします。

包括利益計算書に表示されている以外の損益は認識していません。

添付の注記および組入資産の明細は、財務諸表の不可欠な一部を構成します。

株式資本等変動計算書

2013年4月30日に終了した会計年度

	受益証券 元本 米ドル	剰余金 米ドル	合計 米ドル
2012年5月1日現在	63,564,693	19,244,353	82,809,046
包括利益合計	-	(6,357,334)	(6,357,334)
買戻消却可能参加型受益証券の発行収入	33,300,000	-	33,300,000
買戻消却可能参加型受益証券の買戻支出	(2,278,023)	-	(2,278,023)
2013年4月30日現在	94,586,670	12,887,019	107,473,689
	受益証券 元本 米ドル	剰余金 米ドル	合計 米ドル
2011年5月1日現在	74,372,796	35,217,444	109,590,240
包括利益合計	-	(15,973,091)	(15,973,091)
買戻消却可能参加型受益証券の発行収入	4,000,000	-	4,000,000
買戻消却可能参加型受益証券の買戻支出	(14,808,103)	-	(14,808,103)
2012年4月30日現在	63,564,693	19,244,353	82,809,046

添付の注記および組入資産の明細は、財務諸表の不可欠な一部を構成します。

財務諸表の注記

2013年4月30日

1. 概要

ダイワ“ RICI ”ファンド（以下、「本信託」という）は、受託会社と運用会社による2006年10月31日付け信託証書により、ケイマン諸島の修正信託法に準拠するオープンエンド型投資信託として設定されました。

本信託は、2007年11月13日に運用を開始した、ケイマン諸島の修正ミューチュアル・ファンド法に基づく規制対象ミューチュアル・ファンドです。

本信託の投資目標は、本信託総資産の50%以上を国債、社債その他の米ドル建て債券に投資し、残りの資産を、ロジャーズ国際コモディティ指数（以下、「RICI」という）に連動するよう設計された商品先物と商品先渡し契約に投資することにより、RICIと同等のパフォーマンスをあげることです。本信託の基準通貨は米ドルです。

2013年3月15日付けで、Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.（以下、「DAM SGP」という）がDaiwa Asset Management (Europe) Ltd の代わりに投資運用会社に指名されました。従って、2013年3月15日以降は投資アドバイザーは存在しません。

2. 重要な会計方針

本信託が採用する重要な会計方針は以下の通りです。

作成の基準

財務諸表は取得原価主義に従って作成されており、保有する金融資産および負債は損益を通じて公正価値で修正再評価されています。また財務諸表は、アイルランドの財務報告基準に従って作成されています。

公正価額評価損益通算金融資産および負債

本項目は売買目的の金融資産および負債と、期首に損益を通じて公正価値で経営陣により指定される金融資産および負債の2つに分かれます。

債券および先物契約は、売買目的の保有（以下、「売買目的有価証券」）に分類しています。デリバティブはすべて、本信託が該当金額を受け取る場合には資産に、支払う場合には負債に計上されます。債券および先物契約に係る公正価値の変動は、包括利益計算書に計上されます。

本信託の売買目的有価証券は、取引日に計上され、取得時点の公正価値で認識されます。また取引費用は、発生する毎に費用として計上し包括利益計算書に区分されます。先物契約を含む上場株式あるいは規制市場で取引されている有価証券は、市場価格に基づく公正価値で評価されます。

譲渡制限のない債券のうち残存期間が3カ月未満のものは、公正価値で評価されます（つまり、プレミアム償却または割引額の回復調整後の取得価額）。

売買目的有価証券に係る損益は「先入れ先出し法」に基づいて計算し、包括利益計算書に計上しています。

財務諸表の注記

2013年4月30日

（ 続き ）

2. 重要な会計方針（続き）

公正価額評価損益通算金融資産および負債（続き）

金融派生商品は通常、想定元本に基づきます。想定元本は、当該金融商品への本信託の参加の程度を示しています。2013年4月30日現在および2012年4月30日現在保有されている金融派生商品の想定元本または契約価額は、組入資産の明細に記載されています。

先物：先物契約では、合意した将来の期日に合意した価格で、特定の金融商品、コモディティ、証券を一方の当事者が売却、もう一方の当事者が購入する義務を負います。未決済の先物契約に関しては、財政状態計算書作成日現在の公正価値を算出し、その価値の変動を未実現損益として認識しています。すべての先物契約のカウンターパーティーはNewEdge USA, LLCです。

公正価値

公正価値の見積りは市場環境および金融商品に関する情報を基に、特定の時点に行われます。当該見積りは主観的なもので、重大な判断に関する不確実性や問題を伴うため正確に決定することはできません。前提が変われば、見積りが大きく変わる可能性があります。

機能通貨および表示通貨

本信託の財務諸表上の項目は、運用する主要経済環境の通貨（以下、「機能通貨」）である米ドルで評価されます。米ドルは本信託の表示通貨でもあります。

財務業績の報告

財務諸表の様式およびいくつかの表現は、FRS3「財務業績の報告」に記載されている様式および表現を採用しています。そのため、受託会社の意見においては本信託業務の投資ファンドとしての性質をより適切に反映しています。

キャッシュフロー計算書

本信託は、FRS1「財務諸表の表示」に基づきオープンエンド型投資信託が利用することのできる適用除外を利用しており、キャッシュフロー計算書を作成していません。

収益 / （損失）

利息収入 / （損失）は実効利回りベースで計上されます。

費用

費用は発生主義で計上されます。

現金および証拠金

受託会社であるG.A.S. (Cayman) Limitedは、本信託の資産保管会社としてSMT Trustees (Ireland) Limitedを任命しました。SMT Trustees (Ireland) Limitedは（「サブカストディアン」）としてSumitomo Mitsui Trust (UK) Limitedを任命し、Sumitomo Mitsui Trust (UK) Limited は次にBrown Brothers Harriman & Co.（以下、「BBH」という）をグローバル・サブカストディアンに任命しました。現金は、BBHに保管されている当初の満期が3カ月以下の短期資金です。保有する / 未払いの証拠金は、先物契約のためにNewEdge USA, LLCに差し入れた / 支払うべき現金です。

財務諸表の注記

2013年4月30日

（ 続き ）

2. 重要な会計方針（続き）

買戻消却可能参加型受益証券

本信託は、受益証券保有者が買戻請求をすることができる買戻消却可能参加型受益証券を発行しており、財務報告基準第25号（改訂）にしたがって資本に分類しています。同改訂が定めている厳格な基準に違反するような、受益証券にかかる諸条件の変更がなされた場合は、同証券が報告基準を充足しなくなった日からその受益証券は金融負債に振り替えられます。同金融負債は、振り替えがなされた日現在の受益証券の公正価値で測定されます。受益証券の帳簿価額と振り替え日における同金融負債の公正価値との差異は、資本に認識されます。本受益証券は、本信託の目論見書にしたがって計算した本信託の取引純資産価値の持分割合と同等の現金と引き換えに、本信託に買戻しを請求することができます。

3. 金融商品の公正価値

下記の表には、以下に基づく公正価値間で分析された公正価値で金融商品を認識し、表示しています。

- ・同一の資産もしくは負債の、活発な市場における市場価格(レベル1)
- ・当該資産もしくは負債に関して直接的(価格)であれ間接的(価格からの導出)であれ観察可能なインプットで、レベル1の市場価格以外のもの(レベル2)
- ・当該資産もしくは負債に関するインプットで、観察可能な市場データに基づかないもの(観察不可能なインプット)(レベル3)

2013年	レベル1 米ドル	レベル2 米ドル	レベル3 米ドル	合計 米ドル
公正価額評価損益通算金融資産				
売買目的保有:				
-債券	-	72,483,208	-	72,483,208
-先物契約	1,461,070	-	-	1,461,070
	<u>1,461,070</u>	<u>72,483,208</u>	<u>-</u>	<u>73,944,278</u>

財務諸表の注記

2013年4月30日

（ 続き ）

3. 金融商品の公正価値（続き）

2013年(続き)	レベル1 米ドル	レベル2 米ドル	レベル3 米ドル	合計 米ドル
公正価額評価損益通算金融負債				
売買目的保有:				
-先物契約	3,766,734	-	-	3,766,734
	<u>3,766,734</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>3,766,734</u>
2012年				
	レベル1 米ドル	レベル2 米ドル	レベル3 米ドル	合計 米ドル
公正価額評価損益通算金融資産				
売買目的保有:				
-債券	-	63,983,898	-	63,983,898
-先物契約	613,733	-	-	613,733
	<u>613,733</u>	<u>63,983,898</u>	<u>-</u>	<u>64,597,631</u>
公正価額評価損益通算金融負債				
売買目的保有:				
-先物契約	2,203,718	-	-	2,203,718
	<u>2,203,718</u>	<u>-</u>	<u>-</u>	<u>2,203,718</u>

当年度においてレベル間の移動はありませんでした(2012年:ゼロ)。

4.財務リスク管理

	2013年 米ドル	2012年 米ドル
公正価額評価損益通算金融資産		
売買目的保有:		
-債券	72,483,208	63,983,898
-先物契約	1,461,070	613,733
	<u>73,944,278</u>	<u>64,597,631</u>
公正価額評価損益通算金融資産合計	73,944,278	64,597,631

財務諸表の注記

2013年4月30日

（ 続き ）

4. 財務リスク管理（ 続き ）

	2013年 米ドル	2012年 米ドル
公正価額評価損益通算金融負債		
売買目的保有:		
-先物契約	3,766,734	2,203,718
公正価額評価損益通算金融負債合計	3,766,734	2,203,718

本信託の金融商品から生じる主なリスクは以下の通りです。

市場リスク

保有する金融資産の将来の価格に関する不確実性から市場リスクが生じます。これは、価格変動にあたり、市場ポジションの保有によって本信託が被る可能性のある損失を示すものです。

本信託の投資目標は、本信託総資産の50%以上をドル建て債券に投資することにより、短期的に安定した収益を上げ、また国際的に用いられるコモディティに関連する金融商品の「バスケット」に投資することにより、コモディティの国際価格の上昇の恩恵を享受することです。金融商品の選別および比率はRICIに類似し、同指数にしたがって決定されます。したがって、ファンド・オブ・ファンズは関連する商品市場に関するリスクを負います。市場の変動と本信託のパフォーマンスは定期的に監視されています。大きな差異が生じた場合、投資運用会社はその理由を探ります。市場価格も定期的に確認されています。

本信託はRICIのパフォーマンスを連動することをめざしていることから、RICIの投資先である商品先物市場に投資しています。

RICIは農産品からエネルギー商品や金属商品を網羅し、国際経済で消費されるコモディティのバスケットの価値を表示するもので、バスケットの価値は上場されている37種類の各コモディティに関する先物契約を通じて連動します。RICIの管理および検討については、ロジャース・インターナショナル・コモディティ指数委員会が行っています。投資運用会社は、本信託のパフォーマンスがRICIを日々連動しているか確認しています。

本信託のパフォーマンスがRICIから乖離している場合、投資運用会社はポジションの概要と資金の変動を調査します。パフォーマンスの乖離は本信託とRICIの日々のパフォーマンスの監視により判別され、10bpsの乖離があれば調査されます。

財務諸表の注記

2013年4月30日

(続き)

4. 財務リスク管理（続き）

市場リスク（続き）

RICI指数が変動すれば、本信託のパフォーマンスも同じ方向に同様の幅で変動します。

	2013年	2012年
RICI 指数	3,572.45	3,784.48
1受益証券当たりの純資産価値	96.781米ドル	103.576米ドル

RICIが4.75%変動すれば（2012年：-12.96%）、本信託の純資産価値は3.26%、3,502,589ドル変動し（2012年：-13.78%、-10,732,052ドル）、RICIが-4.75%変動する場合は、同額ですが逆の影響を被ることになります（2012年：12.96%）。

分析の限界に関する開示

- ・感応度分析は過去のデータに基づいており、将来の市場価格の変動、市場間の相関、市場の逼迫している状況における市場流動性の水準が過去のパターンと関連しないことがあることを考慮できません。
- ・市場価格のリスク情報はリスクに関する相対的な見通しであり、正確なものではありません。
- ・市場価格のリスク情報は仮説に基づく結果を表示しており、予測を意図したものではありません。
- ・将来の市場の状況は、過去と大きく異なることがあります。

流動性リスク

流動性リスクは、ボラティリティが高く、信用が逼迫している際に、本信託が妥当な価格で投資ポジションの規模を迅速に調整できない可能性を示しています。商品先物は通常、流動性が高いものです。RICIの構成項目は流動性を考慮して決定されます。保有債券の多くは流動性が高く、定期的に決済され売却されます（約定日1日後決済）。なお決済日は固定されています。RICIの変動は定期的に監視されています。本信託の主な債務は、投資家が買戻すことを希望する受益証券の買戻しです。

運用会社もしくはその代理人である事務管理代行会社は、NAVの決定および受益証券の発行・買戻しを延期すること、ならびに/または目論見書に記載される一定の条件が満たされる期間全体もしくはその一部において買戻しのため受益証券を提出した者への買戻金の支払期間を延期することができます。

当該延期はその公表により直ちに発効し、それ以降は運用会社もしくはその代理人である事務管理代行会社が延期の終了を公表するまではNAVを決定しないものとします。

運用会社は受益証券保有者の利益保護の目的で、自らの単独の裁量で、評価日に買戻される受益証券の総数を発行済み受益証券数の10%に制限することができます。この場合、当該制限は比例配分で適用され、評価日に買戻しのため受益証券の提出を希望する受益証券保有者全員が当該受益証券を同じ割合で買戻しのために提出できるようにします。

財務諸表の注記

2013年4月30日

（ 続き ）

4. 財務リスク管理（ 続き ）

流動性リスク（ 続き ）

運用会社は、当該制限の対象となる受益証券保有者に通知します。評価日に買戻されないすべての受益証券の買戻請求、それに上記の期間までに受領したその後のすべての買戻請求は、次回の評価日に繰り越されます。次回の評価日に、当該買戻請求の対象であるすべての受益証券は買戻されます。買戻請求が繰り越された場合、繰り越されている期間に応じて繰り越された買戻請求を以降の評価日の買戻しにおいて優先します。

以下の表は、本信託の金融負債および確定した正味のデリバティブ金融負債を、財政状態計算書作成日時点の契約上の満期日までの残存期間に基づいて、満期グループに分類したものです。表の金額は、契約上の割引前キャッシュフローです。1年以内に支払期限が到来する残高は帳簿残高と等しく、割引の影響はほとんどありません。

2013年	1カ月未満 米ドル	1～3カ月 米ドル	3カ月超～1年 米ドル	合計 米ドル
未払証拠金	310,454	-	-	310,454
支払勘定 - 1年以内に支払期限が到来するもの	-	109,077	-	109,077
公正価額評価損益通算金融負債	1,363,141	2,392,853	10,740	3,766,734
金融負債合計	1,673,595	2,501,930	10,740	4,186,265
2012年	1カ月未満 米ドル	1～3カ月 米ドル	3カ月超～1年 米ドル	合計 米ドル
未払証拠金	151,912	-	-	151,912
支払勘定 - 1年以内に支払期限が到来するもの	7,995,380	100,420	-	8,095,800
公正価額評価損益通算金融負債	767,197	1,428,715	7,806	2,203,718
金融負債合計	8,914,489	1,529,135	7,806	10,451,430

財務諸表の注記

2013年4月30日

（ 続き ）

4. 財務リスク管理（ 続き ）

信用リスク

本信託は取引相手の信用リスクにさらされており、また決済不履行のリスクも負います。2013年4月30日現在、33,214,300ドルのネットの証拠金（2012年は21,024,219ドル）および2,305,664ドルの売買目的有価証券（2012年は1,589,985ドル）はNewEdge USA, LLCに保管されていました。4,190,783ドルの現金（2012年は7,486,512ドル）と時価総額72,483,208ドルの売買目的有価証券（2012年は63,983,898ドル）はBBHが保管していました。BBHの信用格付けはA+（フィッチ）（2012年：フィッチA+）、NewEdge USA, LLC はA+/A+（フィッチ）（2012年：フィッチA+/A+）です。

信用リスクは、取引相手を選定する際に検討されます。本信託は評価の高いカウンターパーティーとのみ取引しており、さらに本信託の債務証券、先物契約、証拠金は分離されています。現金はBBHの帳簿上で認識可能かつ本信託に属していると記録されている限りにおいて分離されています。しかし、BBHが清算される場合には本信託は当該現金に関してBBHの一般債権者となります。取引の決済は定期的に監視されています。資産保管会社またはNewedge USA, LLCによって二重担保とされる可能性のある資産はありません。本信託の保有する組入資産はすべて、格付がA1/P1です（2012年はA1/P1）

デリバティブ以外の金融資産で、認識された各金融資産に係る義務をカウンターパーティーが履行しなかった場合の本信託がかかえる信用リスクは、最大で、財政状態計算書に表示されたそれらの資産の帳簿価額になります。金融派生商品に関しては、契約もしくは取り決めに基づく義務を取引相手が履行できない可能性から信用リスクが生じます。

為替リスク

本信託の資産の一部は、米ドル以外の通貨の有価証券に投資されており、このような証券による本信託の収入はこれらの通貨で受け取ることになります。なかには、ドルに対して下落する可能性のある通貨もあります。本信託は、本信託の基準通貨である米ドルで純資産価値を算定しています。従って、本信託は為替リスクを伴い、本受益証券の価値に影響を及ぼす可能性があります。

本信託の投資および現金の通貨ポジションは以下の通りです。

	2013年 米ドル	2012年 米ドル
オーストラリア・ドル	(39,122)	(36,929)
カナダ・ドル	60,879	23,022
ユーロ	296,577	124,428
日本円	(243,370)	(61,213)
英国ポンド	17,564	(50,898)
合計	92,528	(1,590)

仮に、2013年4月30日現在の米ドルの対オーストラリア・ドル為替レートが1%低くなっていた場合、純資産は391ドル増加していました（2012年は369ドル）。一方、1%高くなった場

合、その他の変数が変わらないとすると、通貨エクスポージャーに対し、同額ですが、逆の影響が生じます。

財務諸表の注記

2013年4月30日

(続き)

4. 財務リスク管理 (続き)

為替リスク (続き)

仮に、2013年4月30日現在の米ドルの対カナダ・ドル為替レートが1%低くなっていた場合、純資産は609ドル減少していました(2012年は230ドル)。一方、1%高くなった場合、その他の変数が変わらないとすると、通貨エクスポージャーに対し、同額ですが、逆の影響が生じます。

仮に、2013年4月30日現在の米ドルの対ユーロ為替レートが1%低くなっていた場合、純資産は2,966ドル減少していました(2012年は1,244ドル)。一方、1%高くなった場合、その他の変数が変わらないとすると、通貨エクスポージャーに対し、同額ですが、逆の影響が生じます。

仮に、2013年4月30日時点で米ドルの対日本円為替レートが1%低くなった場合、純資産は2,434ドル増加していました(2012年は612ドルの増加)。一方、1%高くなった場合、その他の変数が変わらないとすると、通貨エクスポージャーに対し、同額ですが、逆の影響が生じます。

仮に、2013年4月30日現在の米ドルの対英国ポンド為替レートが1%低くなっていた場合、純資産は176ドル減少していました(2012年は509ドルの増加)。一方、1%高くなった場合、その他の変数が変わらないとすると、通貨エクスポージャーに対し、同額ですが、逆の影響が生じます。

1%の変動は、投資運用会社による米ドルの外国通貨レートの変動に対する合理的な見積もりに基づくものです。

金利リスク

本信託は債券の金利リスクにさらされています。本信託は内容が高く、高格付けのドル建て金融商品(主に米国Tビル)に投資しています。投資運用会社はこれらの証券に関するいかなる金利リスクも監視し、本信託が償還までの期間が1~3カ月のコマーシャルペーパーの売買によって実勢の市場金利の変動により大きなリスクを負うことがないようにします。

金利は実勢のインターバンク・レートに基づく変動金利で現金残高に対して支払われます。2013年4月30日現在および2012年4月30日現在、合理的に考えられるいかなる金利の変動も純資産に重大な影響を及ぼすことはありません。

債券を12カ月保有するとし、またその他の変数が変わらないとした場合において金利が0.25%(2012年は1%)上昇すると、当会計年度の公正価額に基づく債券の公正価額は181,208ドル変動します(2012年は639,840ドル)。一方、金利が0.25%(2012年は1%)低下すると、その他の変数が変わらないとすると、逆の影響が生じます。

0.25%(2012年は1%)の変動は、投資運用会社による市場金利の変動の合理的な見積もりに基づくものです。

財務諸表の注記

2013年4月30日

(続き)

4. 財務リスク管理(続き)

金利リスク(続き)

満期分析表

以下の表は、2013年4月30日現在および2012年4月30日現在の本信託の金融資産および負債の満期構成を記載したものです。

	1カ月未満 米ドル	1~3カ月 米ドル	3カ月超 米ドル	無利息 米ドル	合計 米ドル
2013年					
資産					
現金	4,190,783	-	-	-	4,190,783
証拠金	33,524,754	-	-	-	33,524,754
未収利息	-	-	-	139	139
公正価額評価損益通算金融資産	22,999,089	-	49,484,119	1,461,070	73,944,278
資産合計	60,714,626	-	49,484,119	1,461,209	111,659,954
負債					
未払証拠金	310,454	-	-	-	310,454
支払手数料引当金	-	-	-	109,077	109,077
公正価額評価損益通算金融負債	-	-	-	3,766,734	3,766,734
負債合計	310,454	-	-	3,875,811	4,186,265
利息感応度差異合計	60,404,172	-	49,484,119	N/A	N/A
2012年					
資産					
現金	7,486,512	-	-	-	7,486,512
証拠金	21,176,131	-	-	-	21,176,131
未収利息	-	-	-	202	202
公正価額評価損益通算金融資産	7,999,960	47,988,558	7,995,380	613,733	64,597,631
資産合計	36,662,603	47,988,558	7,995,380	613,935	93,260,476

負債

未払証拠金	151,912	-	-	-	151,912
支払手数料引当金	-	-	-	100,420	100,420
未払購入済投資	-	-	-	7,995,380	7,995,380
公正価額評価損益通算金融負債	-	-	-	2,203,718	2,203,718
負債合計	151,912	-	-	10,299,518	10,451,430
利息感応度差異合計	36,510,691	47,988,558	7,995,380	N/A	N/A

財務諸表の注記

2013年4月30日

(続き)

4. 財務リスク管理 (続き)**金利リスク (続き)****分析の限界に関する開示**

- ・感応度分析は過去のデータに基づいており、将来の市場の変動、市場間の相関、市場の逼迫している状況における市場流動性の水準が過去のパターンと関連しないことがあることを考慮できません。
- ・市場のリスク情報はリスクに関する相対的な見通しであり、正確なものではありません。
- ・市場のリスク情報は仮説に基づく結果を表示しており、予測を意図したものではありません。
- ・将来の市場の状況は、過去と大きく異なることがあります。

5. 現金および証拠金

現金は、BBHに保管されている当初の満期が3カ月以下の現金残高です。保有する / 未払いの証拠金は、先物契約のためにNewEdge USA, LLCに差し入れた / 支払うべき現金です。

ネットの証拠金33,214,300ドル(2012年は21,024,219ドル)は先物契約に関連するため、本信託がこのようなポジションを解消するまで、引き出しを制限されることがあります。

6. 受取勘定

	2013年 米ドル	2012年 米ドル
未収利息	139	202
	139	202

7. 支払勘定 - 1年以内に支払期限が到来するもの

	注記	2013年 米ドル	2012年 米ドル
支払手数料引当金	9	109,077	100,420
未払購入済投資		-	7,995,380
		<u>109,077</u>	<u>8,095,800</u>

財務諸表の注記

2013年4月30日

(続き)

8. 発行済みおよび買戻消却済み買戻消却可能参加型受益証券

	2013年	2012年
米ドル建て買戻消却可能参加型受益証券		
年度初め/期首の発行済み買戻消却可能参加型受益証券数	799,504	900,363
買戻消却可能参加型受益証券の発行数	333,381	38,741
買戻消却可能参加型受益証券の買戻消却数	<u>(22,400)</u>	<u>(139,600)</u>
年度末/期末の発行済み買戻消却可能参加型受益証券数	<u>1,110,485</u>	<u>799,504</u>

本信託は、買戻消却可能な受益証券を発行します。これは、受益証券保有者の選択で買戻消却することが可能であり、資本として分類されます。買戻消却可能参加型受益証券は、本信託の純資産価値に対する比率に等しい現金でいつでも本信託を買戻すことができます。受益証券は、受益証券保有者が本信託に対して買戻請求権を行使した場合に、財政状態計算書作成日現在に支払われる買戻価額で認識しています。

買戻消却可能参加型受益証券は、発行時または買戻時の1受益証券当りの本信託の純資産価値に基づいた価格で、受益証券保有者の選択により発行および買戻されます。1受益証券当りの本信託の純資産価値は、買戻消却可能参加型受益証券保有者に帰属する純資産を発行済みの同受益証券数で除すことにより計算されます。

受益証券は100%、JTSB STB Daiwa RICI Mother Fundが保有しています。（2012年：100%）。

買戻消却可能参加型受益証券は評価日、もしくは運用会社が特定のケースで決定できるその他の時点の1営業日前の午後12時（ダブリン時間）までに買戻通知書または申込書を提出することにより、評価日に買戻されるか、もしくは引き受けられます。

9. 手数料および費用

受託会社は、本信託資産から5,000ドルを前払手数料として、純資産価値の年率0.01%を月次手数料として受け取ります。月次手数料は各評価日に発生し計算され、毎月後払いで支払われます。

運用会社は、本信託資産から純資産価値の年率0.825%を手数料として受け取ります。手数料は各評価日に発生し計算され、毎月後払いで支払われます。

運用会社は、投資運用会社の手数料として純資産価値の年率0.41%を自己の負担で支払う責任を負います。投資運用会社は投資アドバイザーの手数料を自己の負担で支払う責任を負います。運用会社はまた、日本における運用会社の代理人の手数料、純資産価値の年率0.395%を自己の負担で支払う責任を負います。投資運用会社と日本における運用会社の代理人の手数料を支払った後、運用会社は、運用会社の手数料の残存金額、純資産価値の年率0.02%を保持します。

財務諸表の注記

2013年4月30日

(続き)

9. 手数料および費用 (続き)

事務管理代行会社は、受託会社から本信託資産の純資産価値の年率0.15%を手数料として受け取ります。この手数料は各評価日に発生し計算され、毎月後払いで支払われます。

本信託は、事務管理代行会社の適正な裏付けのある合理的な支払い、費用、料金、現金支出(事務管理代行会社またはその代理人による本信託への事務管理代行サービスの提供において発生した法律費用その他の費用など)に責任を負います。

資産保管会社は、受託会社から本信託資産の純資産価値の年率0.015%を手数料として受け取ります。この手数料は各評価日に発生し計算され、毎月後払いで支払われます。サブカस्टディアンは、証券取引1件毎に10ドル、現金取引1件毎に15ドルを受け取る権利を有しています。

さらに資産保管会社は、本信託資産から、通例の代理人手数料および保険費用などの経費のすべて、サブカस्टディアンの手数料および費用、ならびに資産保管会社の職務遂行中に発生した、適正な裏付けのある合理的な支払い、費用、料金および現金支出のすべての払い戻しを受けます。

本信託の設定に関連する費用および経費は、約60,000ドルと推定されます。この費用および経費は本信託の最初の会計期間に支出されました。

未払手数料は以下の通りです。

	2013年	2012年
	米ドル	米ドル
運用会社報酬	63,067	55,942

管理報酬	11,464	10,163
受託会社報酬	764	678
カストディフィー	1,146	1,016
監査費用	28,306	27,532
その他の費用	4,330	5,089
	<u>109,077</u>	<u>100,420</u>

10. 関連当事者の取引

財務上あるいは業務上の意思決定にあたり、一方の当事者がもう一方の当事者を支配できる場合、あるいはもう一方の当事者に対して重大な影響力を行使できる場合には、両当事者は関連するものとみなされます。通常業務を除き、関連当事者との取引はありませんでした。受託会社、運用会社、投資運用会社、投資アドバイザー、事務管理代行会社、資産保管会社、および関連企業は、本信託と関連するとみなされます。事務管理代行会社、受託会社、資産保管会社およびサブカストディアンは、同一の最終親会社を持つことから関連会社となります。当期中に関連当事者に支払った費用は、包括利益計算書に開示しています。期末時点で関連当事者に支払うべき金額は、注記9に開示されています。

財務諸表の注記

2013年4月30日

(続き)

11. 公正価額評価損益通算金融資産および負債による純損失

	2013年 米ドル	2012年 米ドル
純実現損失:		
-先物契約	(4,723,957)	(12,140,934)
-証券および通貨への投資	14,843	(5,599)
	<u>(4,709,114)</u>	<u>(12,146,533)</u>
正味評価損の変動:		
-先物契約	(715,681)	(2,712,923)
-証券および通貨への投資	26,272	(195,314)
	<u>(689,409)</u>	<u>(2,908,237)</u>
取得ディスカウントの償却	75,187	109,750
公正価額評価損益通算金融資産および負債による純損失	<u>(5,323,336)</u>	<u>(14,945,020)</u>

12. 利益の分配に関する方針

本信託は、受益証券保有者に分配を行わない方針です。

13. 課税

ケイマン諸島の現行法では、本信託が支払う所得税、資産税、譲渡税、売上税その他の税金はありません。このため財務諸表には納税引当金は計上されていません。本信託は、特定の利息、配当、キャピタルゲインに対して外国で税金を源泉徴収されることがあります。

14. 純資産価値の推移

	2013年	2012年
純資産価値	107,473,689米ドル	82,809,046米ドル
受益証券数	1,110,485	799,504
1受益証券当たりの純資産価値	96.781米ドル	103.576米ドル

財務諸表の注記

2013年4月30日

(続き)

15. 本レポートで用いる為替レート

以下の為替レートを用いて、資産および負債を米ドルに換算しました。

	2013年	2012年
オーストラリア・ドル	0.963340	0.957720
カナダ・ドル	1.005850	0.980950
ユーロ	0.758500	0.754180
日本円	97.410000	80.450000
英国ポンド	0.642510	0.615860

16. 後発事象

2013年4月30日以降2013年10月29日までの本信託の引受額は41,050,000ドルで、買戻額は1,149,473ドルでした。

財務諸表に開示する必要のある期末以降の後発事象は他にありません。

組入資産の明細

2013年4月30日

純資産に
占める

債券	額面	公正価値	比率
		米ドル	(%)
米国			
US T-Bill 0% 16-May-13	23,000,000	22,999,089	21.40
US T-Bill 0% 22-Aug-13	23,000,000	22,994,946	21.40
US T-Bill 0% 19-Sep-13	23,500,000	23,490,336	21.85
US T-Bill 0% 3-Oct-13	3,000,000	2,998,837	2.79
債券合計		72,483,208	67.44

先物契約	数量	想定元本 米ドル	評価益 米ドル	評価損 米ドル
フランス				
Milling Wheat (MNP) - Nov-2013	79	1,096,770	13,761	-
Rapeseed (MNP) - Aug-2013	38	1,094,117	-	(6,345)
		2,190,887	13,761	(6,345)
日本				
Rubber (TCM) - Oct-2013	77	1,035,135	2,756	-
		1,035,135	2,756	-
英国				
Brent Crude Oil (IPE) - Jun-2013	48	5,245,080	-	(331,320)
Brent Crude Oil (ICE) - Jul-2013	97	9,967,000	-	(69,120)
Coffee Robusta (LIF) - Jul-2013	107	2,205,470	-	(57,980)
Copper Grade A (LME) - May-2013	21	4,090,406	-	(400,969)
Copper Grade A (LME) - May-2013	(21)	(3,925,469)	236,031	-
Copper Grade A (LME) - Jun-2013	24	4,479,331	-	(253,831)
Copper Grade A (LME) - Jun-2013	(16)	(2,836,800)	19,800	-
Copper Grade A (LME) - Jul-2013	16	2,840,200	-	(19,800)
Gas Oil (IPE) - Jun-2013	5	459,075	-	(34,200)
Gas Oil (ICE) - Jul-2013	10	859,875	-	(5,875)
No 7 Cocoa (LIF) - Jul-2013	47	1,084,481	42,770	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2013	82	4,081,869	-	(311,919)

Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2013	(82)	(3,854,819)	84,869	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2013	93	4,408,281	-	(90,756)

添付の注記および組入資産の明細は、財務諸表の不可欠な一部を構成します。

組入資産の明細

2013年4月30日

(続き)

先物契約 (続き)	数量	想定元本 米ドル	評価益 米ドル	評価損 米ドル
英国 (続き)				
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2013	(62)	(2,900,631)	22,281	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jul-2013	61	2,866,063	-	(21,938)
Primary Nickel (LME) - May-2013	10	997,764	-	(77,994)
Primary Nickel (LME) - May-2013	(10)	(985,632)	65,862	-
Primary Nickel (LME) - Jun-2013	11	1,085,400	-	(71,772)
Primary Nickel (LME) - Jun-2013	(7)	(647,748)	2,712	-
Primary Nickel (LME) - Jul-2013	8	740,952	-	(2,712)
Special High Grade Zinc (LME) - May- 2013	39	1,998,294	-	(204,050)
Special High Grade Zinc (LME) - May- 2013	(39)	(1,805,944)	11,700	-
Special High Grade Zinc (LME) - Jun- 2013	47	2,191,125	-	(10,325)
Special High Grade Zinc (LME) - Jun- 2013	(31)	(1,453,700)	15,300	-
Special High Grade Zinc (LME) - Jul- 2013	30	1,414,125	-	(14,625)
Standard Lead (LME) - May-2013	36	2,043,619	-	(233,044)
Standard Lead (LME) - May-2013	(36)	(1,855,050)	44,475	-
Standard Lead (LME) - Jun-2013	42	2,171,425	-	(49,638)
Standard Lead (LME) - Jun-2013	(28)	(1,420,563)	6,038	-
Standard Lead (LME) - Jul-2013	28	1,423,713	-	(6,038)
Tin (LME) - May-2013	9	1,050,285	-	(135,165)
Tin (LME) - May-2013	(9)	(1,037,550)	122,430	-
Tin (LME) - Jun-2013	10	1,148,170	-	(130,720)
Tin (LME) - Jun-2013	(7)	(720,195)	7,980	-

Tin (LME) - Jul-2013	7	720,685	-	(7,980)
White Sugar (LIF) - Aug-2013	43	1,065,660	20,305	-
		<u>37,194,247</u>	<u>702,553</u>	<u>(2,541,771)</u>
米国				
Corn (CBT) - Jul-2013	159	5,108,288	59,213	-
Cotton No 2 (NYB) - Jul-2013	106	4,739,300	-	(103,390)
Frozen Concentrated Orange Juice (NYB) - Jul-2013	31	632,408	20,453	-
Gasoline RBOB FUT (NYM) - Jun-2013	9	1,136,071	-	(76,915)
Gasoline RBOB FUT (NYM) - Jul-2013	18	2,112,340	-	(7,636)
Gold (CMX) - Jun-2013	7	1,096,810	-	(66,340)
Gold (CMX) - Aug-2013	15	2,206,990	3,260	-
Heating Oil (NYM) - Jun-2013	5	636,850	-	(40,534)
Heating Oil (NYM) - Jul-2013	11	1,317,876	-	(5,796)
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jun-2013	27	1,092,220	80,390	-

添付の注記および組入資産の明細は、財務諸表の不可欠な一部を構成します。

組入資産の明細

2013年4月30日

(続き)

先物契約 (続き)	数量	想定元本 米ドル	評価益 米ドル	評価損 米ドル
米国 (続き)				
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jul-2013	50	2,209,000	-	(12,000)
Lean Hogs (CME) - Jun-2013	10	364,680	5,620	-
Lean Hogs (CME) - Aug-2013	19	698,990	1,350	-
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Jun-2013	81	7,824,490	-	(254,230)
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Jul-2013	160	15,072,000	-	(83,200)
Live Cattle (CME) - Jun-2013	15	743,270	-	(11,870)
Live Cattle (CME) - Aug-2013	29	1,425,670	-	(4,090)
Lumber (CME) - Jul-2013	27	1,142,768	-	(101,783)
Milk Future (CME) - May-2013	1	36,860	480	-
Milk Future (CME) - Jun-2013	2	78,260	-	(100)
Oat (CBT) - Jul-2013	28	525,138	23,312	-

Palladium (NYM) - Jun-2013	1	75,800	-	(6,020)
Palladium (NYM) - Sep-2013	3	210,215	-	(305)
Platinum (NYM) - Jul-2013	26	2,053,665	-	(94,304)
Rough Rice (CBT) - Jul-2013	27	849,500	-	(33,830)
Silver (CMX) - Jul-2013	17	2,327,775	-	(272,050)
Soybean Meal (CBT) - Jul-2013	20	796,540	32,460	-
Soybean Oil (CBT) - Jul-2013	72	2,164,998	-	(38,693)
Soybeans (CBT) - Jul-2013	54	3,715,838	61,462	-
Sugar No 11 World (NYB) - Jul-2013	55	1,089,693	-	(5,532)
Wheat (CBT) - Jul-2013	146	4,974,000	362,300	-
Wheat (KCB) - Jul-2013	29	1,053,075	91,700	-
		<u>69,511,378</u>	<u>742,000</u>	<u>(1,218,618)</u>
先物契約合計		<u>109,931,647</u>	<u>1,461,070</u>	<u>(3,766,734)</u>

添付の注記および組入資産の明細は、財務諸表の不可欠な一部を構成します。

組入資産の明細

2012年4月30日

債券	額面	公正価値 米ドル	純資産
			に占め る比率 (%)
オーストラリア			
Export Finance and Insurance 0.15% YLD Corp 19-Jun-12	3,000,000	2,999,388	3.62
Export Finance and Insurance 0.16% YLD Corp 12-Jul-12	5,000,000	4,998,451	6.04
Western Australia Treasury 0.18% YLD Corp 08- Jun-12	8,000,000	7,998,481	9.66
Western Australia Treasury 0.18% YLD Corp 13- Jun-12	5,000,000	4,998,926	6.04
Western Australia Treasury 0.20% YLD Corp 14- Aug-12	8,000,000	<u>7,995,380</u>	<u>9.65</u>

28,990,626 35.01

オーストリア

Oesterreich Kontrollbank 0.18% YLD Corp 02-May-12	8,000,000	7,999,960	9.66
Oesterreich Kontrollbank 0.20% YLD Corp 14-Jun-12	8,000,000	7,998,046	9.66
Oesterreich Kontrollbank 0.20% YLD Corp 25-Jun-12	5,000,000	4,998,473	6.04
		<u>20,996,479</u>	<u>25.36</u>

デンマーク

Kommunekredit 0.20% YLD Corp 07-Jun-12	7,000,000	6,998,562	8.45
		<u>6,998,562</u>	<u>8.45</u>

ヨーロッパ

Eurofima 0.14% YLD Corp 05-Jul-12	7,000,000	6,998,231	8.45
		<u>6,998,231</u>	<u>8.45</u>

債券合計63,983,898 77.27

添付の注記および組入資産の明細は、財務諸表の不可欠な一部を構成します。

組入資産の明細

2012年4月30日

(続き)

		想定元本	評価益	評価損
先物契約	数量	米ドル	米ドル	米ドル

カナダ

Canola Meal (WCE) - Jul-2012	51	638,552	25,677	-
		<u>638,552</u>	<u>25,677</u>	<u>-</u>
フランス				
Milling Wheat (MNP) - Nov-2012	62	840,897	-	(7,508)
Rapeseed (MNP) - Aug-2012	7	220,256	4,591	-
		<u>1,061,153</u>	<u>4,591</u>	<u>(7,508)</u>
日本				
Azuki Red Beans (TGE) - Oct-2012	10	127,483	-	(298)
Rubber (TCM) - Oct-2012	42	816,252	516	-
		<u>943,735</u>	<u>516</u>	<u>(298)</u>
英国				
Brent Crude Oil (IPE) - Jun-2012	63	7,777,120	-	(227,830)
Brent Crude Oil (IPE) - Jul-2012	32	3,820,800	-	-
Copper Grade A (LME) - May-2012	16	3,429,388	-	(31,788)
Copper Grade A (LME) - May-2012	(16)	(3,392,800)	-	(4,800)
Copper Grade A (LME) - Jun-2012	16	3,392,288	-	(13,888)
Copper Grade A (LME) - Jun-2012	(5)	(1,055,688)	-	(63)
Copper Grade A (LME) - Jul-2012	5	1,053,063	-	(63)
Gas Oil (IPE) - Jun-2012	7	711,850	-	(9,050)
Gas Oil (IPE) - Jul-2012	3	300,375	-	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2012	62	3,606,781	-	(386,656)
Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2012	(62)	(3,276,831)	56,706	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2012	62	3,295,325	-	(50,788)
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2012	(21)	(1,098,825)	-	(131)
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jul-2012	21	1,105,519	-	(263)

Primary Nickel (LME) - May-2012	7	817,536	-	(59,856)
Primary Nickel (LME) - May-2012	(7)	(743,754)	-	(13,926)
Primary Nickel (LME) - Jun-2012	8	850,410	16,902	-
Primary Nickel (LME) - Jun-2012	(3)	(325,170)	-	(72)
Primary Nickel (LME) - Jul-2012	3	325,710	-	(18)

添付の注記および組入資産の明細は、財務諸表の不可欠な一部を構成します。

組入資産の明細

2012年4月30日

(続き)

先物契約 (続き)	数量	想定元本 米ドル	評価益 米ドル	評価損 米ドル
英国 (続き)				
Special High Grade Zinc (LME) - May-2012	33	1,742,950	- -	(65,725)
Special High Grade Zinc (LME) - May-2012	(33)	(1,648,625)	-	(28,600)
Special High Grade Zinc (LME) - Jun-2012	34	1,702,381	29,919	-
Special High Grade Zinc (LME) - Jun-2012	(12)	(611,250)	-	(150)
Special High Grade Zinc (LME) - Jul-2012	11	561,413	-	(138)
Standard Lead (LME) - May-2012	(31)	(1,573,325)	-	(87,887)
Standard Lead (LME) - May-2012	31	1,698,706	-	(37,493)
Standard Lead (LME) - Jun-2012	34	1,729,988	93,688	-
Standard Lead (LME) - Jun-2012	(12)	(643,500)	-	(150)
Standard Lead (LME) - Jul-2012	10	535,063	-	(63)
Tin (LME) - May-2012	7	832,920	-	(47,064)
Tin (LME) - May-2012	(7)	(800,460)	14,605	-
Tin (LME) - Jun-2012	8	917,235	-	(18,274)

Tin (LME) - Jun-2012	(3)	(335,600)	-	(1,510)
Tin (LME) - Jul-2012	2	224,980	-	(30)
		24,925,973	211,820	(1,086,276)

米国

Cocoa (NYB) - Jul-2012	36	805,440	25,800	-
Coffee C (NYB) - Jul-2012	24	1,659,000	-	(70,500)
Corn (CBT) - Jul-2012	129	4,077,525	-	(43,050)
Cotton No 2 (NYB) - Jul-2012	75	3,515,250	-	(94,124)
Frozen Concentrated Orange Juice (NYB) - Jul-2012	21	509,520	-	(43,320)
Gasoline Rbob (NYM) - Jun-2012	12	1,653,876	-	(69,047)
Gasoline Rbob (NYM) - Jul-2012	6	780,368	-	-
Gold (CMX) - Jun-2012	10	1,719,750	-	(54,950)
Gold (CMX) - Aug-2012	5	833,600	-	-
Heating Oil (NYM) - Jun-2012	7	947,646	-	(11,698)
Heating Oil (NYM) - Jul-2012	4	535,147	-	-
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jun-2012	70	1,592,150	-	(61,950)
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jul-2012	37	850,630	-	-
Lean Hogs (CME) - Jun-2012	15	590,480	-	(70,880)

添付の注記および組入資産の明細は、財務諸表の不可欠な一部を構成します。

組入資産の明細

2012年4月30日

(続き)

先物契約(続き)	数量	想定元本 米ドル	評価益 米ドル	評価損 米ドル
----------	----	-------------	------------	------------

米国(続き)

Lean Hogs (CME) - Aug-2012	8	281,600	-	-
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Jun-2012	111	11,617,260	29,970	-
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Jul-2012	55	5,792,600	-	-
Live Cattle (CME) - Jun-2012	23	1,170,950	-	(132,730)
Live Cattle (CME) - Aug-2012	12	554,640	-	-
Lumber (CME) - Jul-2012	28	831,281	45,595	-
Milk Future (CME) - May-2012	2	62,920	-	(3,400)
Milk Future (CME) - Jun-2012	1	28,420	-	(20)
Oat (CBT) - Jul-2012	25	422,813	4,374	-
Palladium (NYM) - Jun-2012	3	208,695	-	(4,245)
Palladium (NYM) - Sep-2012	1	68,300	34	-
Platinum (NYM) - Jul-2012	19	1,617,675	-	(120,760)
Rough Rice (CBT) - Jul-2012	21	635,040	5,670	-
Silver (CMX) - Jul-2012	11	1,792,240	-	(64,635)
Soybean Meal (CBT) - Jul-2012	16	617,890	67,550	-
Soybean Oil (CBT) - Jul-2012	50	1,661,514	4,386	-
Soybeans (CBT) - Jul-2012	40	2,799,250	187,750	-
Sugar No 11 World (NYB) - Jul-2012	66	1,750,694	-	(182,851)
Wheat (CBT) - Jul-2012	123	4,040,038	-	(42,538)
Wheat (KCB) - Jul-2012	25	862,688	-	(38,938)
		<u>56,886,890</u>	<u>371,131</u>	<u>(1,109,636)</u>
先物契約合計		<u>84,456,303</u>	<u>613,733</u>	<u>(2,203,718)</u>

添付の注記および組入資産の明細は、財務諸表の不可欠な一部を構成します。

投資明細

2013年12月17日現在における当ファンドが組入れている「Daiwa “ RICI ” Fund」の投資状況を示しております。

(単位: USドル)

(1) 社債券

銘柄名	券面総額	評価額	備考
US T-BILL OPCT 20MAR14	36,000,000	35,997,568.91	
US T-BILL OPCT 19DEC13	20,000,000	19,999,857.96	
US T-BILL OPCT 13FEB14	14,000,000	13,998,649.70	
US T-BILL OPCT 29MAY14	13,000,000	12,994,077.77	
US T-BILL OPCT 9JAN14	12,500,000	12,499,691.05	
US T-BILL OPCT 3APR14	9,000,000	8,998,515.37	

(2) 商品先物

(単位: USドル)

銘柄名	買建/売建	数量	評価損益	備考
MILLING WHEAT (EOP) MAR-14	買建	110	-26,911.63	
RAPESEED EURO FUT (EOP) FEB-14	買建	59	-3,466.92	
BRENT CRUDE OIL (ICE) FEB-14	買建	192	-480,780.00	
COFFEE ROBUSTA (LIF) MAR-14	買建	190	272,330.00	
COPPER GRADE A (LME) DEC-13	買建	33	10,300.00	
COPPER GRADE A (LME) DEC-13	売建	33	-11,000.00	
COPPER GRADE A (LME) JAN-14	買建	34	7,643.75	
COPPER GRADE A (LME) JAN-14	売建	34	-226,937.50	
COPPER GRADE A (LME) FEB-14	買建	35	224,650.00	
GAS OIL (ICE) FEB-14	買建	19	-50,400.00	
NO 7 COCOA (LIF) MAR-14	買建	54	56,565.68	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-13	買建	131	-249,243.75	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-13	売建	131	289,031.25	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-14	買建	129	-277,337.50	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-14	売建	129	-156,318.75	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) FEB-14	買建	139	164,787.50	
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-13	買建	18	16,455.00	
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-13	売建	18	61,704.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-14	買建	17	-58,830.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-14	売建	17	-61,746.00	
PRIMARY NICKEL (LME) FEB-14	買建	19	68,238.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-13	買建	63	122,037.50	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-13	売建	63	-52,893.75	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-14	買建	62	29,337.50	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-14	売建	62	-159,987.50	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) FEB-14	買建	65	160,393.75	
STANDARD LEAD (LME) DEC-13	買建	57	57,731.25	
STANDARD LEAD (LME) DEC-13	売建	57	76,831.25	
STANDARD LEAD (LME) JAN-14	買建	55	-67,212.50	
STANDARD LEAD (LME) JAN-14	売建	55	-115,087.50	
STANDARD LEAD (LME) FEB-14	買建	59	118,718.75	
TIN (LME) DEC-13	買建	13	-37,445.00	
TIN (LME) DEC-13	売建	13	12,645.00	
TIN (LME) JAN-14	買建	13	-12,190.00	
TIN (LME) JAN-14	売建	13	-10,525.00	
TIN (LME) FEB-14	買建	14	8,255.00	

TIN (LME) FEB-14	売建	1	0.00	
WHITE SUGAR (LIF) MAR-14	買建	66	-136,200.00	
RUBBER (TCM) MAY-14	買建	121	49,554.01	
CORN (CBT) MAR-14	買建	339	-231,737.50	
COTTON NO 2 (NYB) MAR-14	買建	163	326,410.00	
FROZEN CONCENTRATED ORANGE JUICE (NYB) MAR-14	買建	43	34,057.50	
GASOLINE RBOB FUT (NYM) FEB-14	買建	40	-98,809.20	
GOLD (CMX) FEB-14	買建	37	-317,470.00	
HEATING OIL (NYM) FEB-14	買建	21	-62,403.60	
HENRY HUB NATURAL GAS (NYM) FEB-14	買建	117	435,890.00	
LEAN HOGS (CME) FEB-14	買建	42	-81,110.00	
LIGHT SWEET CRUDE OIL (NYM) FEB-14	買建	345	831,310.00	
LIVE CATTLE (CME) FEB-14	買建	57	-24,140.00	
LUMBER (CME) MAR-14	買建	38	-1,562.00	
MILK FUTURE (CME) JAN-14	買建	4	3,660.00	
OAT (CBT) MAR-14	買建	46	61,275.00	
PALLADIUM (NYM) MAR-14	買建	6	-16,330.00	
PLATINUM (NYM) APR-14	買建	40	14,670.00	
ROUGH RICE (CBT) MAR-14	買建	36	-35,120.00	
SILVER (CMX) MAR-14	買建	31	-357,900.00	
SOYBEAN MEAL (CBT) MAR-14	買建	27	6,930.00	
SOYBEAN OIL (CBT) MAR-14	買建	125	-46,026.00	
SOYBEANS (CBT) MAR-14	買建	82	16,887.50	
SUGAR NO 11 WORLD (NYB) MAR-14	買建	79	-71,691.20	
WHEAT (CBT) MAR-14	買建	218	-560,900.00	
WHEAT (KCB) MAR-14	買建	43	-142,850.00	

(注) L M E (ロンドン金属取引所)においては、先渡し売買となるため、期日到来まで反対売買により清算されません。当該取引は売建で表示しております。

[次へ](#)

ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト

(1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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）並びに同規則第38条の3及び第57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、中間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、当中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト

[次へ](#)

(1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		360,964,800
投資信託受益証券		28,010,968,915
流動資産合計		28,371,933,715
資産合計		28,371,933,715
負債の部		
流動負債		
未払解約金		108,707,004
未払受託者報酬		4,971,562
未払委託者報酬		49,716,031
その他未払費用		932,084
流動負債合計		164,326,681
負債合計		164,326,681
純資産の部		
元本等		
元本	1	28,545,197,820
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2	337,590,786
（分配準備積立金）		113,472,957
元本等合計		28,207,607,034
純資産合計		28,207,607,034
負債純資産合計		28,371,933,715

[次へ](#)

(2) 中間損益及び剰余金計算書

	当中間計算期間
	自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日 金額(円)
営業収益	
受取利息	119,799
有価証券売買等損益	121,272,822
営業収益合計	121,392,621
営業費用	
受託者報酬	4,971,562
委託者報酬	49,716,031
その他費用	932,084
営業費用合計	55,619,677
営業利益又は営業損失()	65,772,944
経常利益又は経常損失()	65,772,944
中間純利益又は中間純損失()	65,772,944
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	7,235,776
期首剰余金又は期首欠損金()	301,413,425
剰余金増加額又は欠損金減少額	30,789,324
中間一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	30,789,324
剰余金減少額又は欠損金増加額	125,503,853
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	125,503,853
中間剰余金又は中間欠損金()	337,590,786

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 1期首元本額	19,640,391,978円
期中追加設定元本額	11,025,036,370円
期中一部解約元本額	2,120,230,528円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	28,545,197,820口
3. 2元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は337,590,786円であります。

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成25年6月18日 至 平成25年12月17日
	該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

当中間計算期間末 平成25年12月17日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	当中間計算期間末 平成25年12月17日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)		0.9882円 (9,882円)

2 【ファンドの現況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

ダイワファンドラップ 日本株式セレクト

【純資産額計算書】

平成25年12月30日

資産総額	67,725,487,199円
負債総額	10,739,639円
純資産総額（ - ）	67,714,747,560円
発行済数量	62,823,141,192口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0779円

ダイワファンドラップ 日本債券セレクト

純資産額計算書

平成25年12月30日

資産総額	91,879,036,968円
負債総額	15,118,855円
純資産総額（ - ）	91,863,918,113円
発行済数量	84,770,623,450口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0837円

ダイワファンドラップ 外国株式セレクト

純資産額計算書

平成25年12月30日

資産総額	34,112,338,259円
負債総額	7,041,636円
純資産総額（ - ）	34,105,296,623円
発行済数量	34,142,663,846口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9989円

ダイワファンドラップ 外国株式セレクト エマージングプラス

純資産額計算書

平成25年12月30日

資産総額	47,212,028,998円
負債総額	17,371,902円
純資産総額（ - ）	47,194,657,096円

発行済数量	49,204,339,237口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9592円

ダイワファンドラップ 外国債券セレクト

純資産額計算書

平成25年12月30日

資産総額	23,906,828,476円
負債総額	4,817,225円
純資産総額（ - ）	23,902,011,251円
発行済数量	21,532,847,111口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1100円

ダイワファンドラップ 外国債券セレクト エマージングプラス

純資産額計算書

平成25年12月30日

資産総額	20,057,494,798円
負債総額	8,688,372円
純資産総額（ - ）	20,048,806,426円
発行済数量	17,435,099,511口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1499円

ダイワファンドラップ J-REITセレクト

純資産額計算書

平成25年12月30日

資産総額	20,832,369,932円
負債総額	4,757,290円
純資産総額（ - ）	20,827,612,642円
発行済数量	17,234,615,447口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2085円

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

純資産額計算書

平成25年12月30日

資産総額	28,038,254,839円
負債総額	75,517,821円
純資産総額（ - ）	27,962,737,018円
発行済数量	16,077,298,505口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.7393円

ダイワファンドラップ 外国REITセレクト

純資産額計算書

平成25年12月30日

資産総額	15,126,235,903円
負債総額	4,963,827円
純資産総額（ - ）	15,121,272,076円
発行済数量	14,643,539,790口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0326円

(参考) ダイワ海外REIT・マザーファンド

純資産額計算書

平成25年12月30日

資産総額	15,447,195,432円
負債総額	4,319,086円
純資産総額（ - ）	15,442,876,346円
発行済数量	15,359,781,471口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0054円

ダイワファンドラップ コモディティセレクト

純資産額計算書

平成25年12月30日

資産総額	15,157,944,609円
負債総額	9,965,667円
純資産総額（ - ）	15,147,978,942円
発行済数量	22,471,270,056口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.6741円

(参考) ダイワ・マネー・マザーファンド

純資産額計算書

平成25年12月30日

資産総額	14,611,341,130円
負債総額	0円
純資産総額（ - ）	14,611,341,130円
発行済数量	14,337,988,138口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0191円

ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト

純資産額計算書

平成25年12月30日

資産総額	28,632,806,229円
負債総額	6,449,214円
純資産総額（ - ）	28,626,357,015円
発行済数量	28,881,513,010口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9912円

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

原有価証券届出書の「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 および2 事業の内容及び営業の概況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

平成25年12月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

取締役会は、3名以内の代表取締役を選定し、代表取締役は、会社を代表し、取締役会の決議にしたがい業務を執行します。

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク・監査会議

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

さらに、運用が適切に行なわれたかについて、経営会議の分科会であるオペレーショナルリスク・監査会議において法令等の遵守状況に関する報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成25年12月末日現在、委託会社が運用を行なっている投資信託（親投資信託を除きます。）は次のとおりです。

基本的性格	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
単位型株式投資信託	5	81,831
追加型株式投資信託	504	9,421,550
株式投資信託 合計	509	9,503,381
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	3,290,097
公社債投資信託 合計	17	3,290,097
総合計	526	12,793,477

3 【委託会社等の経理状況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第54期事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第55期事業年度に係る中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

(1) 【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日現在）	当事業年度 （平成25年3月31日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	3,745,233	14,380,327
有価証券	19,655,070	9,427,636
前払金	314	207
前払費用	90,562	142,919
未収入金	11,931	521,825
未収委託者報酬	6,516,540	7,183,011
未収収益	55,102	106,914
貯蔵品	11,888	9,551
繰延税金資産	630,508	491,727
その他	190,450	8,445
流動資産計	30,907,602	32,272,567
固定資産		
有形固定資産	1	1,003,450
建物（純額）	513,162	26,257
器具備品（純額）	484,571	222,274

リース資産（純額）	-	5,726
建設仮勘定	5,715	-
無形固定資産	2,870,849	3,194,512
ソフトウェア	2,173,517	3,132,238
ソフトウェア仮勘定	684,878	50,423
電話加入権	11,850	11,850
商標権	132	-
その他	471	-
投資その他の資産	16,375,520	15,113,434
投資有価証券	10,034,136	8,342,934
関係会社株式	5,141,069	5,141,069
出資金	136,315	136,315
従業員に対する長期貸付金	112,674	92,527
差入保証金	542,920	1,000,820
長期前払費用	8,478	7,376
投資不動産（純額）	1 409,876	1 402,340
貸倒引当金	9,950	9,950
固定資産計	20,249,820	18,562,205
資産合計	51,157,423	50,834,773

（単位：千円）

	前事業年度 （平成24年3月31日現在）	当事業年度 （平成25年3月31日現在）
負債の部		
流動負債		
リース債務	-	1,227
預り金	55,551	56,491
未払金	7,194,946	6,795,899
未払収益分配金	17,954	10,333
未払償還金	88,334	113,002
未払手数料	3,386,380	3,764,501
その他未払金	2 3,702,277	2 2,908,061
未払費用	3,313,011	3,383,551
未払法人税等	963,539	588,040
未払消費税等	229,365	189,139
賞与引当金	307,000	841,300
本社移転関連費用引当金	346,425	-
資産除去債務	292,000	-
その他	87,535	-
流動負債計	12,789,375	11,855,648
固定負債		
リース債務	-	4,494
退職給付引当金	1,670,344	1,935,442
役員退職慰労引当金	68,068	67,410
繰延税金負債	1,782,558	1,740,407
固定負債計	3,520,970	3,747,753
負債合計	16,310,345	15,603,402

純資産の部

株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	7,715,116	7,722,723
利益剰余金合計	8,089,414	8,097,020
株主資本合計	34,759,414	34,767,020
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	33,879	464,350
繰延ヘッジ損益	53,783	-
評価・換算差額等合計	87,663	464,350
純資産合計	34,847,077	35,231,371
負債・純資産合計	51,157,423	50,834,773

(2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	72,931,048	73,498,726
その他営業収益	401,212	526,465
営業収益計	73,332,260	74,025,191
営業費用		
支払手数料	41,050,089	41,213,272
広告宣伝費	709,853	604,864
公告費	699	949
受益証券発行費	74	-
調査費	7,993,144	8,116,701
調査費	878,635	824,915
委託調査費	7,114,509	7,291,786
委託計算費	733,156	807,090
営業雑経費	1,651,996	1,280,599
通信費	205,421	206,564
印刷費	472,511	404,023
協会費	52,117	53,643
諸会費	11,971	11,281
その他営業雑経費	909,973	605,086
営業費用計	52,139,015	52,023,478
一般管理費		
給料	4,452,711	5,264,128
役員報酬	209,630	249,180
給料・手当	3,646,155	3,782,533
賞与	289,926	391,114
賞与引当金繰入額	307,000	841,300
福利厚生費	728,342	809,254
交際費	71,356	55,806
寄付金	591	636
旅費交通費	215,939	196,147
租税公課	171,533	206,178
不動産賃借料	727,939	887,968
退職給付費用	422,030	469,713
役員退職慰労引当金繰入額	27,988	38,970
固定資産減価償却費	1,107,222	1,181,438
諸経費	1,077,041	1,094,627
一般管理費計	9,002,696	10,204,869
営業利益	12,190,548	11,796,843

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)		当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	74,753	1	257,704
有価証券利息		13,537		11,102
受取利息		2,771		10,598
時効成立分配金・償還金		42,189		21,305
投資有価証券売却益		117,695		279,443
有価証券償還益		68,106		101,052
その他		54,685		44,912
営業外収益計		373,739		726,118
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		2,182		19,392
投資有価証券売却損		95,389		36,469
有価証券償還損		67,873		33,338
投資不動産管理費用		16,454		16,271
その他		49,191		23,111
営業外費用計		231,091		128,584
経常利益		12,333,196		12,394,377
特別利益				
投資有価証券売却益		-		39,827
固定資産売却益		-		31
その他		-		16,466
特別利益計		-		56,325
特別損失				
固定資産除却損	2	4,871	2	129,816
減損損失	3	76,217	3	-
有価証券評価損		211,376		-
本社移転関連費用		346,425		1,099,913
その他		19,547		14,428
特別損失計		658,438		1,244,158
税引前当期純利益		11,674,757		11,206,544
法人税、住民税及び事業税		5,254,642		4,286,691
法人税等調整額		602,832		109,902
法人税等合計		4,651,809		4,176,789
当期純利益		7,022,948		7,029,755

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	当事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	15,174,272	15,174,272
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計		
当期首残高	11,495,727	11,495,727
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	374,297	374,297
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	374,297	374,297
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		
当期首残高	9,874,176	7,715,116
当期変動額		
剰余金の配当	9,182,008	7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	2,159,059	7,606
当期末残高	7,715,116	7,722,723
利益剰余金合計		
当期首残高	10,248,473	8,089,414
当期変動額		
剰余金の配当	9,182,008	7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	2,159,059	7,606
当期末残高	8,089,414	8,097,020

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	当事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)
株主資本合計		
当期首残高	36,918,473	34,759,414
当期変動額		
剰余金の配当	9,182,008	7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
当期変動額合計	2,159,059	7,606
当期末残高	34,759,414	34,767,020
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	104,040	33,879
当期変動額		
株主資本以外の項目 の	137,920	430,470
当期変動額(純額)		
当期変動額合計	137,920	430,470
当期末残高	33,879	464,350
繰延ヘッジ損益		
当期首残高	85,902	53,783
当期変動額		
株主資本以外の項目 の	32,119	53,783
当期変動額(純額)		
当期変動額合計	32,119	53,783
当期末残高	53,783	-
評価・換算差額等合計		
当期首残高	18,137	87,663
当期変動額		
株主資本以外の項目 の	105,800	376,686
当期変動額(純額)		
当期変動額合計	105,800	376,686
当期末残高	87,663	464,350
純資産合計		
当期首残高	36,900,336	34,847,077
当期変動額		
剰余金の配当	9,182,008	7,022,149
当期純利益	7,022,948	7,029,755
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	105,800	376,686
当期変動額合計	2,053,258	384,293

当期末残高

34,847,077

35,231,371

注記事項

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. デリバティブの評価基準及び評価方法

時価法により計上しております。

3. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

(リース資産を除く)

定率法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 6～47年

器具備品 3～20年

(会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更)

当社は、法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

(2) 無形固定資産(リース資産を除く)

定額法によっております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づいております。

(3) 長期前払費用

定額法によっております。

（４）リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

４．引当金の計上基準

（１）貸倒引当金

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

（２）賞与引当金

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

（３）退職給付引当金

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

また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当事業年度末要支給額を計上しております。

（４）役員退職慰労引当金

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

（５）本社移転関連費用引当金

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

５．ヘッジ会計の方法

（１）ヘッジ会計の方法

繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用しておりましたが、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計を終了しております。

（２）ヘッジ手段とヘッジ対象

ヘッジ手段・・・株価指数先物

ヘッジ対象・・・投資有価証券

（３）ヘッジ方針

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

（４）ヘッジ有効性評価の方法

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

6. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜処理によっております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(損益計算書)

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「時効成立後支払分配金・償還金」及び「投資不動産管理費用」は重要性が増したため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「その他」に表示していた67,829千円は、「時効成立後支払分配金・償還金」2,182千円、「投資不動産管理費用」16,454千円、「その他」49,191千円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
建物	986,089千円	15,528千円
器具備品	2,234,738千円	250,072千円
リース資産	-	409千円
投資建物	712,587千円	724,130千円
投資器具備品	22,398千円	23,691千円

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
未払金	3,577,654千円	2,883,398千円

3 保証債務

前事業年度（平成24年3月31日現在）

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

当事業年度（平成25年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,591,590千円に対して保証を行っております。

（損益計算書関係）

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には区分掲記されたもののほか次のものがあります。

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
受取配当金	-	185,280千円

2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
建物	-	546千円
器具備品	4,812千円	128,892千円
無形固定資産（その他）	-	377千円
投資不動産	59千円	-
計	4,871千円	129,816千円

3 減損損失に関する注記

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

場所 千葉県浦安市

用途 賃貸等不動産（浦安寮）

種類 建物及び土地

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

浦安寮については、営業活動から生ずるキャッシュ・フローが継続してマイナスとなっており、減損の兆候が認められたため、当該資産グループの帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失（76,217千円）として特別損失に計上しております。その内訳は、建物17,417千円及び土地58,800千円であります。

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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合 計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当 の総額 (百万円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成23年6月24日 定時株主総会	普通株式	9,182	3,520	平成23年 3月31日	平成23年 6月27日

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

平成24年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	7,022百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	2,692円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月26日

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

	当事業年度期首 株式数	当事業年度 増加株式数	当事業年度 減少株式数	当事業年度末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合 計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(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25年6月24日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	7,027百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	2,694円
基準日	平成25年3月31日
効力発生日	平成25年6月25日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業などの資産運用に関する事業を行っております。資金運用については安全性の高い金融商品に限定しております。また、デリバティブ取引は、事業遂行上生じた市場リスクヘッジのために利用し、投機的な取引は行いません。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、投資信託、株式であります。投資信託は余資運用及び事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されております。株式は上場株式、非上場株式並びに子会社株式を保有しており、上場株式は価格変動リスク及び発行体の信用リスクに、非上場株式及び子会社株式は発行体の信用リスクに晒されております。

未払手数料は投資信託の販売に係る手数料の未払額であります。その他未払金は主に連結納税の親会社へ支払う法人税の未払額であります。未払費用は主にファンド運用に係る業務を委託したこと等により発生する費用の未払額であります。これらは、そのほとんどが1年以内の支払期日であります。

デリバティブ取引は株式先物取引を行っております。当社ではこれをヘッジ手段として、ヘッジ対象である投資有価証券に関わる価格変動リスクをヘッジしており、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用してはりましたが、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計の適用を終了しております。なお、ヘッジ会計に関するヘッジ手段とヘッジ対象、ヘッジ方針、ヘッジ有効性評価の方法等については、前述の重要な会計方針「5.ヘッジ会計の方法」をご参照下さい。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務会議において報告を行っております。また、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、保有している投資信託の一部について株式先物取引を利用し価格変動リスクをヘッジしております。なお、繰延ヘッジ処理によってヘッジ会計を適用してはいたしましたが、ヘッジ対象である投資有価証券が売却により消滅したため、ヘッジ会計の適用を終了しております。

（ ）デリバティブ取引

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

信用リスクの管理

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

（４）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

「２．金融商品の時価等に関する事項」におけるデリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

２．金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成24年３月31日現在）

（単位：千円）

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

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

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

当事業年度（平成25年3月31日現在）

（単位：千円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	14,380,327	14,380,327	-
(2) 未収委託者報酬	7,183,011	7,183,011	-
(3) 未収入金	521,825	521,825	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	16,711,401	16,711,401	-
資産計	38,796,567	38,796,567	-
(1) 未払手数料	3,764,501	3,764,501	-
(2) その他未払金	2,908,061	2,908,061	-
(3) 未払費用（*1）	2,782,587	2,782,587	-
負債計	9,455,149	9,455,149	-

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

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

資 産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬並びに(3) 未収入金

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。

(4) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

デリバティブ取引

注記事項（デリバティブ取引関係）をご参照下さい。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

区分	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,163,689	1,059,169
(2) 子会社株式及び関連会社株式		

子会社株式	5,141,069	5,141,069
(3) 差入保証金	542,920	1,000,820

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

<注3>金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成24年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	3,745,233	-	-	-
未収委託者報酬	6,516,540	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	836,311	2,069,432	4,320,954	-
合計	11,098,084	2,069,432	4,320,954	-

当事業年度(平成25年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	14,380,327	-	-	-
未収委託者報酬	7,183,011	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	-	1,434,397	4,840,276	-
合計	21,563,339	1,434,397	4,840,276	-

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成24年3月31日現在)

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

当事業年度(平成25年3月31日現在)

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

2. その他有価証券

前事業年度(平成24年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	6,864,572	6,497,516	367,056
小計	6,864,572	6,497,516	367,056
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
(1) 株式	49,871	55,101	5,230
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	21,611,072	21,918,194	307,122
小計	21,660,944	21,973,296	312,352
合計	28,525,516	28,470,813	54,703

(注) 非上場株式（貸借対照表計上額 1,163,689千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度（平成25年3月31日現在）

	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの			
(1) 株式	93,459	55,101	38,357
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	6,224,312	5,440,857	783,455
小計	6,317,771	5,495,959	821,812
貸借対照表計上額が取得 原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	10,393,629	10,493,953	100,323
小計	10,393,629	10,493,953	100,323
合計	16,711,401	15,989,912	721,489

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
(1) 株式	141,128	39,827	-
(2) その他 証券投資信託の受益証券	28,114,625	279,443	36,469
合計	28,255,753	319,271	36,469

4. 減損処理を行った有価証券

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

当事業年度において、その他有価証券(非上場株式)について3,220千円の減損処理を行っております。

(デリバティブ取引関係)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

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

前事業年度(平成24年3月31日現在)

株式関連

(単位:千円)

区分	デリバティブ 取引の種類等	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の 取引	株価指数先物取引 売建 TOPIX先物	1,669,315	-	87,535	87,535
	合計	1,669,315	-	87,535	87,535

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

当事業年度(平成25年3月31日現在)

該当事項はありません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。

2. 退職給付債務に関する事項

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
退職給付債務	1,670,344千円	1,935,442千円
退職給付引当金	1,670,344千円	1,935,442千円

3. 退職給付費用に関する事項

	前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)
勤務費用	261,341千円	301,777千円
その他	160,689千円	167,935千円
退職給付費用	442,030千円	469,713千円

(注) 「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日現在)	当事業年度 (平成25年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	838,826	837,121
退職給付引当金	599,247	693,199
賞与引当金	116,690	280,855
連結法人間取引(譲渡損)	258,256	264,269
繰延資産	12	157,330
未払事業税	212,753	154,219
投資有価証券評価損	191,138	128,953
出資金評価損	114,425	114,425
未払社会保険料	14,071	43,411
器具備品	33,365	33,316
役員退職慰労引当金	25,804	24,920
本社移転関連費用引当金	131,676	-
資産除去債務	110,989	-
有価証券評価損	80,344	-
その他有価証券評価差額金	27,099	-
その他	27,474	29,627
繰延税金資産小計	2,782,177	2,761,651
評価性引当額	1,379,241	1,323,069
繰延税金資産合計	1,402,935	1,438,582
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,428,233	2,428,233
建物(資産除去債務)	76,837	-
繰延ヘッジ損益	29,783	-
その他有価証券評価差額金	18,241	257,138

その他	1,888	1,888
繰延税金負債合計	2,554,985	2,687,261
繰延税金負債の純額	1,152,049	1,248,679

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

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1. 当該資産除去債務の概要

旧日本の不動産賃貸借契約に係る原状回復義務であります。

2. 当該資産除去債務の金額の算定方法

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

3. 当該資産除去債務の総額の増減

（単位：千円）

変動の内容	前事業年度 （自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）	当事業年度 （自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）
期首残高	-	292,000
見積りの変更に伴う増加額	292,000	-
資産除去債務の履行による減少額	-	292,000
期末残高	292,000	-

4. 当該資産除去債務の金額の見積りの変更

前事業年度において、本社移転計画に基づく合理的な見積りが可能となったため、当該資産除去債務292,000千円を貸借対照表に計上しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

（単位：千円）

	資産運用に関する事業	合計
減損損失	76,217	76,217

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
----	--------	-----	-------------------	-------	---------------------------	-----------	-------	--------------	----	--------------

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,372,770	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	--------------	------	----------	-----------	---	---

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

当事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,591,590	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

(注) シンガポール通貨庁(MAS)に対する当社からの保証状により、当該関連当事者の債務不履行等に関するMASへの損害等に対して保証しております。なお、債務総額は当該関連当事者の総運用資産額に応じて保証状にて定められております。

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	19,792,278	未払手数料	2,376,978
同一の親会社をもつ会社	大和証券キャピタル・マーケット(株)	東京都千代田区	255,700	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	595,391	未払手数料	76,686
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,233,996	未払費用	245,735

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を兄弟会社に支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

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

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

当事業年度（自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金 または 出資金 (百万円)	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	20,510,864	未払手数料	2,758,584
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	1,205,721	未払費用	82,519
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料	1,194,567	長期差入保証金	971,157
									未収入金	511,559

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。

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

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

2. 親会社に関する注記

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

(1 株当たり情報)

前事業年度 (自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日)		当事業年度 (自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日)	
1株当たり純資産額	13,358.92円	1株当たり純資産額	13,506.24円
1株当たり当期純利益	2,692.30円	1株当たり当期純利益	2,694.91円

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

(注) 2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成23年４月１日 至 平成24年３月31日)	当事業年度 (自 平成24年４月１日 至 平成25年３月31日)
当期純利益(千円)	7,022,948	7,029,755
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		当中間会計期間 (平成25年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		565,010
有価証券		21,111,923
未収委託者報酬		8,007,008
貯蔵品		11,855
繰延税金資産		610,353
その他		460,696
流動資産計		30,766,848
固定資産		
有形固定資産	1	258,610
無形固定資産		
ソフトウェア		2,759,986
その他		95,853
無形固定資産合計		2,855,839
投資その他の資産		
投資有価証券		13,716,293
その他	1	1,627,256
貸倒引当金		9,950
投資その他の資産合計		15,333,600
固定資産計		18,448,051
資産合計		49,214,899

(単位:千円)

		当中間会計期間 (平成25年9月30日)
負債の部		
流動負債		
リース債務		1,227
未払金		6,519,299
未払費用		3,233,085
未払法人税等		1,115,633
賞与引当金		879,500
その他	3	443,391
流動負債計		12,192,137
固定負債		
リース債務		3,885
退職給付引当金		1,983,018

役員退職慰労引当金	86,895
繰延税金負債	1,699,959
固定負債計	3,773,758
負債合計	15,965,895
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	374,297
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	5,812,608
利益剰余金合計	6,186,905
株主資本合計	32,856,905
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	392,098
評価・換算差額等合計	392,098
純資産合計	33,249,004
負債・純資産合計	49,214,899

(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		42,527,881
その他営業収益		392,427
営業収益計		42,920,308
営業費用		
支払手数料		23,860,060
その他営業費用		5,551,085
営業費用計		29,411,146
一般管理費	1	5,464,561
営業利益		8,044,600
営業外収益	2	189,595
営業外費用	1, 3	40,337
経常利益		8,193,859
特別利益		-
特別損失		-
税引前中間純利益		8,193,859
法人税、住民税及び事業税		3,195,671

法人税等調整額	119,063
中間純利益	5,117,251

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)
株主資本	
資本金	
当期首残高	15,174,272
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	11,495,727
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,495,727
資本剰余金合計	
当期首残高	11,495,727
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	374,297
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	374,297
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	
当期首残高	7,722,723
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,027,366
中間純利益	5,117,251
当中間期変動額合計	1,910,115
当中間期末残高	5,812,608

(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)

利益剰余金合計	
当期首残高	8,097,020
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,027,366
中間純利益	5,117,251
当中間期変動額合計	1,910,115
当中間期末残高	6,186,905
株主資本合計	
当期首残高	34,767,020
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,027,366
中間純利益	5,117,251
当中間期変動額合計	1,910,115
当中間期末残高	32,856,905
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	464,350
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	72,252
当中間期変動額合計	72,252
当中間期末残高	392,098
評価・換算差額等合計	
当期首残高	464,350
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	72,252
当中間期変動額合計	72,252
当中間期末残高	392,098
純資産合計	
当期首残高	35,231,371
当中間期変動額	
剰余金の配当	7,027,366
中間純利益	5,117,251
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	72,252
当中間期変動額合計	1,982,367
当中間期末残高	33,249,004

注記事項

(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)
--	--

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p>	<p>(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により計上しております。</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの 中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。</p> <p>時価のないもの 移動平均法による原価法を採用しております。</p>				
<p>2. 固定資産の減価償却の方法</p>	<p>(1) 有形固定資産及び投資不動産(リース資産を除く) 定額法によっております。 なお、主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table data-bbox="590 604 1133 683"> <tr> <td>建物</td> <td>6～47年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>3～20年</td> </tr> </table> <p>(会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更) 当社は、当中間会計期間より有形固定資産(投資不動産を含む)の減価償却方法を定率法から定額法に変更いたしました。 この変更は、本社移転を契機に当社の有形固定資産の使用実態を見直した結果、当社において使用する有形固定資産は安定的に使用されており、その投資効果は、耐用年数の期間中に平均的・安定的に発現するものであるため、定額法が当社の企業活動をより適切に反映した減価償却方法であると判断したためであります。 この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微です。</p> <p>(2) 無形固定資産(リース資産を除く) 定額法によっております。 なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づいております。</p> <p>(3) 長期前払費用 定額法によっております。</p> <p>(4) リース資産 リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。</p>	建物	6～47年	器具備品	3～20年
建物	6～47年				
器具備品	3～20年				
<p>3. 引当金の計上基準</p>	<p>(1) 貸倒引当金 債権等の貸倒損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率法により、貸倒懸念債権及び破産更生債権等については財務内容評価法により計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 役員及び従業員に対する賞与の支給に備えるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。これは、当社の退職金は、将来の昇給等による給付額の変動がなく、貢献度、能力及び実績等に応じて各事業年度ごとに各人別の勤務費用が確定するためであります。また、執行役員・参与についても、当社の退職金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p> <p>(4) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間末要支給額を計上しております。</p>				

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項	(1) 消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。 (2) 連結納税制度の適用 連結納税制度を適用しております。
------------------------------	---

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間 (平成25年9月30日)	
1. 減価償却累計額	
有形固定資産	279,239千円
投資その他の資産	750,645千円
2. 債務保証	
子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,633,380千円に対して保証を行っております。	
3. 消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。	

(中間損益計算書関係)

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	
有形固定資産	13,229千円
無形固定資産	467,147千円
投資その他の資産	3,475千円
2. 営業外収益の主要項目	
受取配当金	66,775千円
投資有価証券売却益	62,800千円
有価証券償還益	23,635千円
3. 営業外費用の主要項目	
有価証券償還損	18,420千円
投資不動産管理費用	9,067千円
貯蔵品廃棄損	4,963千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年6月24日 定時株主総会	普通株式	7,027	2,694	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

(金融商品関係)

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)

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、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません(<注2>参照のこと)。

(単位:千円)

	中間貸借対照表計 上額	時価	差額
(1) 現金・預金	565,010	565,010	-
(2) 未収委託者報酬	8,007,008	8,007,008	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	28,627,978	28,627,978	-
資産計	37,199,997	37,199,997	-
(1) 未払金	6,519,299	6,519,299	-
(2) 未払費用(*1)	2,812,213	2,812,213	-
負債計	9,331,512	9,331,512	-

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

<注1>金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払金及び(2) 未払費用

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

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	1,059,169
子会社株式	5,141,069
長期差入保証金	1,001,278

これらは、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるものであるため、時価開示の対象としておりません。

(有価証券関係)

当中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	109,770	55,101	54,669
証券投資信託の受益証券	5,692,625	5,093,365	599,259
小計	5,802,396	5,148,467	653,928
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
証券投資信託の受益証券	22,825,582	22,870,284	44,702
小計	22,825,582	22,870,284	44,702
合計	28,627,978	28,018,751	609,226

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

(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、資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間（自 平成25年 4月 1日 至 平成25年 9月30日）

1. サービスごとの情報

当社のサービスは、単一であるため記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦顧客からの営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間（自 平成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 (自 平成25年 4月 1日 至 平成25年 9月30日)	
1 株当たり純資産額	12,746.28円
1 株当たり中間純利益金額	1,961.74円

(注) 1 . 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載して
おりません。

2 . 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

中間純利益(千円)	5,117,251
普通株式に係る中間純利益(千円)	5,117,251
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 4 利害関係人との取引制限および5 その他」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。

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

提出日前1年以内において、訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼした事実または重要な影響を及ぼすことが予想される事実はありません。

独立監査人の中間監査報告書

平成26年1月24日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 貞廣 篤典 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日本株式セレクトの平成25年6月18日から平成25年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、ダイワファンドラップ 日本株式セレクトの平成25年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の損益の状況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

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

以 上

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

（注2） 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年1月24日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林 英之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日本債券セレクトの平成25年6月18日から平成25年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、ダイワファンドラップ 日本債券セレクトの平成25年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の損益の状況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

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

以 上

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

(注2) 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年1月24日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 貞廣 篤典 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式セレクトの平成25年6月18日から平成25年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、ダイワファンドラップ 外国株式セレクトの平成25年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の損益の状況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

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

以 上

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

(注2) 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年1月24日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 貞廣 篤典 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式セレクト エマージングプラスの平成25年6月18日から平成25年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、ダイワファンドラップ 外国株式セレクト エマージングプラスの平成25年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の損益の状況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

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

以 上

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

（注2） 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年1月24日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 貞廣 篤典 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券セレクトの平成25年6月18日から平成25年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、ダイワファンドラップ 外国債券セレクトの平成25年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の損益の状況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

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

以 上

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

(注2) 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年1月24日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林 英之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券セレクト エマージングプラスの平成25年6月18日から平成25年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、ダイワファンドラップ 外国債券セレクト エマージングプラスの平成25年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の損益の状況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

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

以 上

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

（注2） 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年1月24日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 貞廣 篤典 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ J-REITセレクトの平成25年6月18日から平成25年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、ダイワファンドラップ J-REITセレクトの平成25年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の損益の状況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

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

以 上

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

(注2) 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年1月24日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林 英之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国REITセレクトの平成25年6月18日から平成25年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、ダイワファンドラップ 外国REITセレクトの平成25年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の損益の状況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

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

以 上

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

（注2） 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年1月24日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	小林 英之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ コモディティセレクトの平成25年6月18日から平成25年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、ダイワファンドラップ コモディティセレクトの平成25年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の損益の状況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

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

以 上

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

（注2） 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年1月24日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 貞廣 篤典 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 小林 英之 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクトの平成25年6月18日から平成25年12月17日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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、ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクトの平成25年12月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年6月18日から平成25年12月17日まで）の損益の状況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

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

以 上

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

（注2） 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年 5月29日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森	公高	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣	篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田	和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第54期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成25年11月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高 波 博 之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞 廣 篤 典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内 田 和 男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第55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、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成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

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