

【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28年3月8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】 山村 政
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03-5555-3111

【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27年9月9日から平成28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27年9月8日付で提出した有価証券届出書（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】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

< 訂正前 >

< 略 >

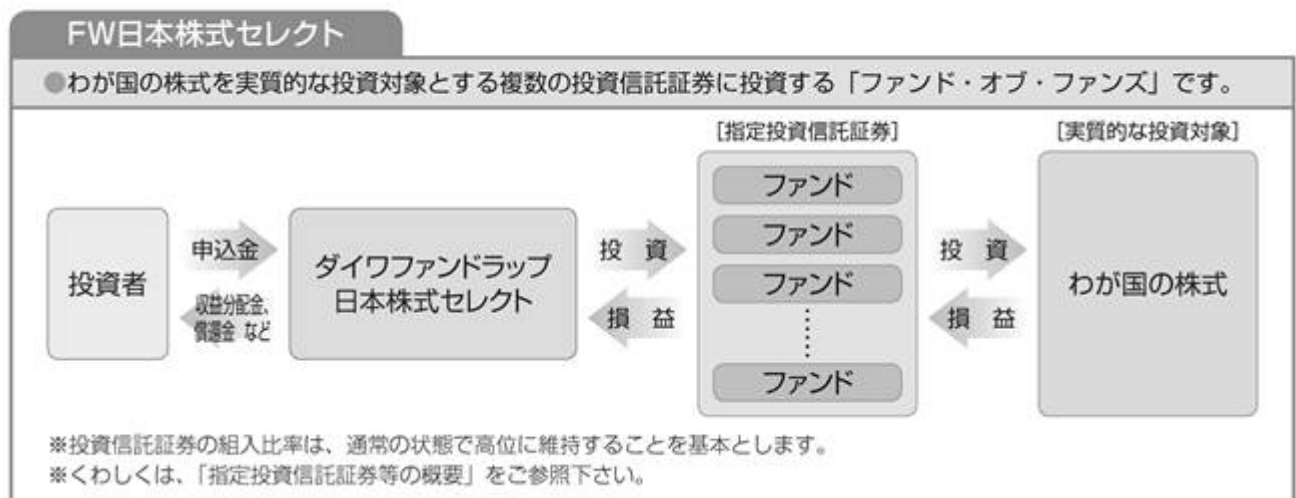
< ファンドの特色 >

< 略 >

2 < 略 >

< 略 >

ファンドの仕組み



投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

FW日本債券セレクト

●わが国の債券を実質的な投資対象とする複数の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。



※投資信託証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

※くわしくは、「指定投資信託証券等の概要」をご参照下さい。

投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

FW外国株式セレクト

●海外の株式を実質的な投資対象とする複数の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。



※投資信託証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

※保有実質外貨建資産については、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。

※くわしくは、「指定投資信託証券等の概要」をご参照下さい。

投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

FW外国株式EM+

●海外の株式を実質的な投資対象とする複数の投資信託証券（新興国の株式を中心に運用を行なう投資信託証券を含みます。なお、新興国の株式を中心に運用を行なう投資信託証券の組入比率は信託財産総額の50%を上限とします。）に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。



※投資信託証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

※保有実質外貨建資産については、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。

※くわしくは、「指定投資信託証券等の概要」をご参照下さい。

投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

FW外国債券セレクト

● 海外の債券を実質的な投資対象とする複数の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。



※投資信託証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

※保有実質外貨建資産については、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。

※くわしくは、「指定投資信託証券等の概要」をご参照下さい。

投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

FW外国債券EM+

● 海外の債券を実質的な投資対象とする複数の投資信託証券（新興国の債券を中心に運用を行なう投資信託証券を含みます。なお、新興国の債券を中心に運用を行なう投資信託証券の組入比率は信託財産総額の50%を上限とします。）に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。



※投資信託証券の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。

※保有実質外貨建資産については、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。

※くわしくは、「指定投資信託証券等の概要」をご参照下さい。

投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

FW J-REITセレクト

● ファミリーファンド方式で運用を行ないます。



※マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも信託財産の純資産総額の90%程度以上とすることを基本とします。

※くわしくは、「指定投資信託証券等の概要」をご参照下さい。

投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

< 略 >

FW外国REITセレクト

●ファミリーファンド方式で運用を行いません。



※保有実質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。

※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%程度以上とすることを基本とします。

※保有実質外貨建資産については、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いません。

※くわしくは、「指定投資信託証券等の概要」をご参照下さい。

投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

< 略 >

FWコモディティセレクト

●「ダイワ・マネー・マザーファンド」と「ダイワ "RICI" ファンド」に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。



※通常の状態では「ダイワ "RICI" ファンド」への投資割合を高位（信託財産の純資産総額の90%程度以上）とすることを基本とします。

※保有実質外貨建資産については、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いません。

※くわしくは、「指定投資信託証券等の概要」をご参照下さい。

< 略 >

FWヘッジFセレクト

●絶対収益の獲得をめざす複数の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。



※投資信託証券の組入比率は、通常の状態では高位に維持することを基本とします。

※保有実質外貨建資産については、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いません。

※くわしくは、「指定投資信託証券等の概要」をご参照下さい。

投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

< ファンドの特色 >

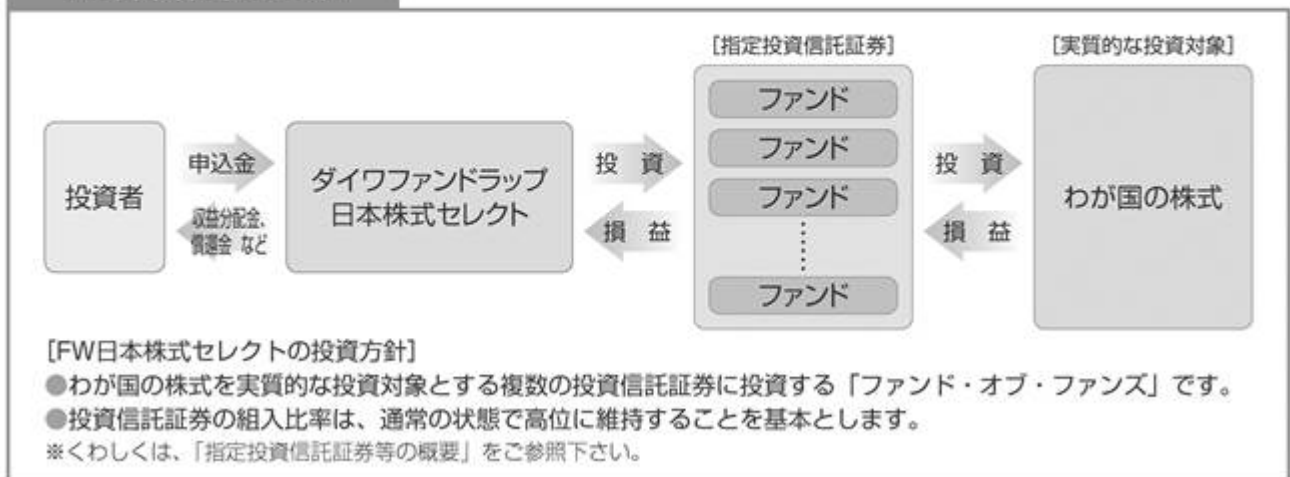
< 略 >

2 < 略 >

< 略 >

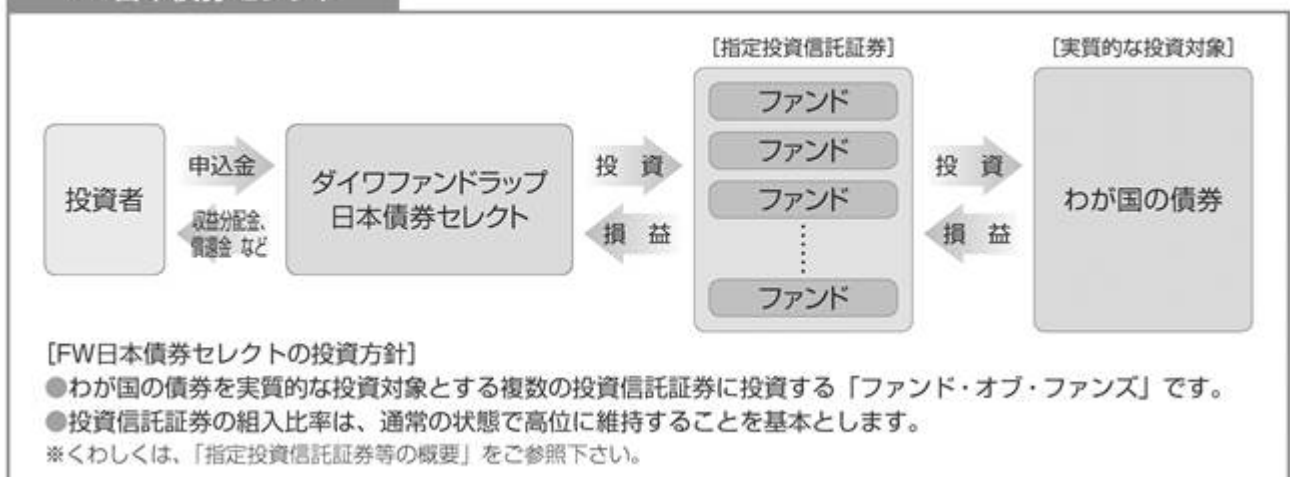
ファンドの仕組み

FW日本株式セレクト

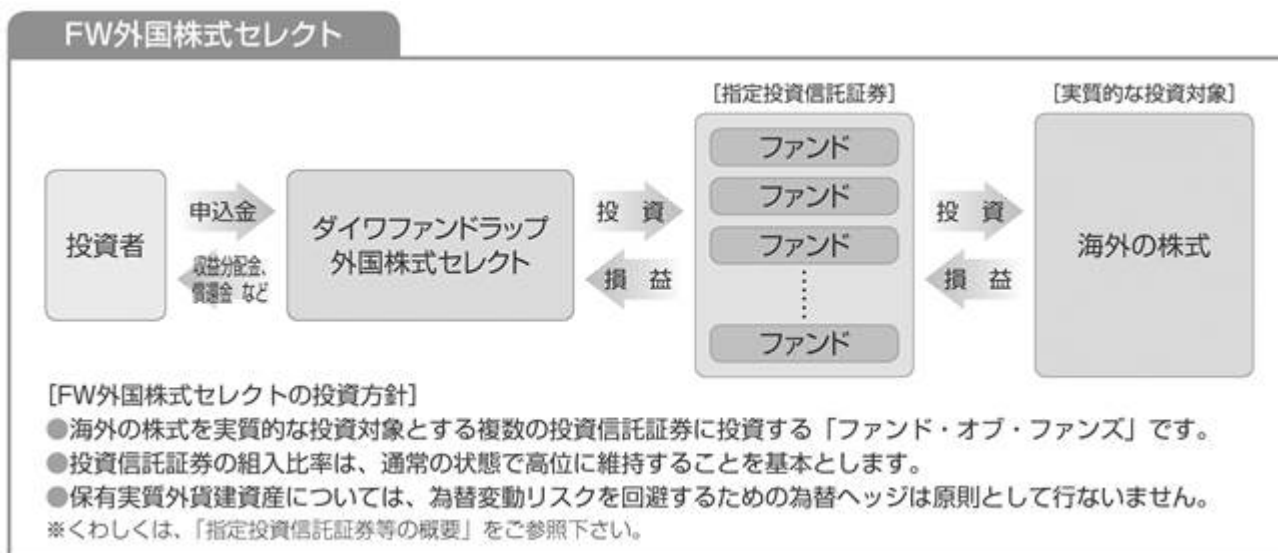


投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

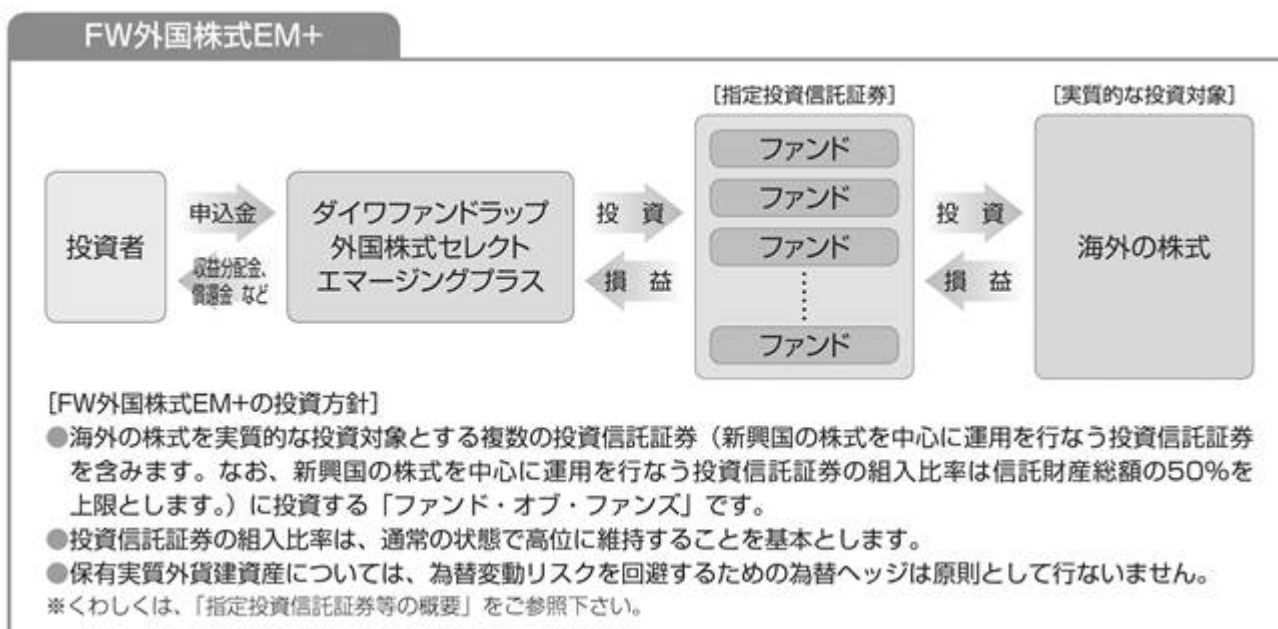
FW日本債券セレクト



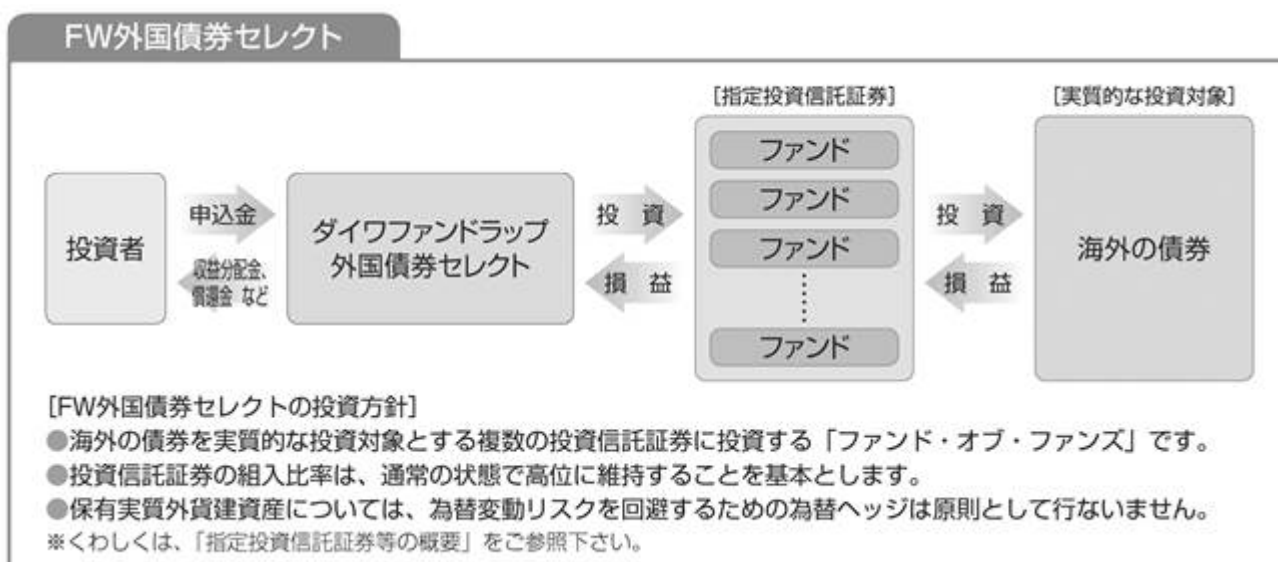
投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。



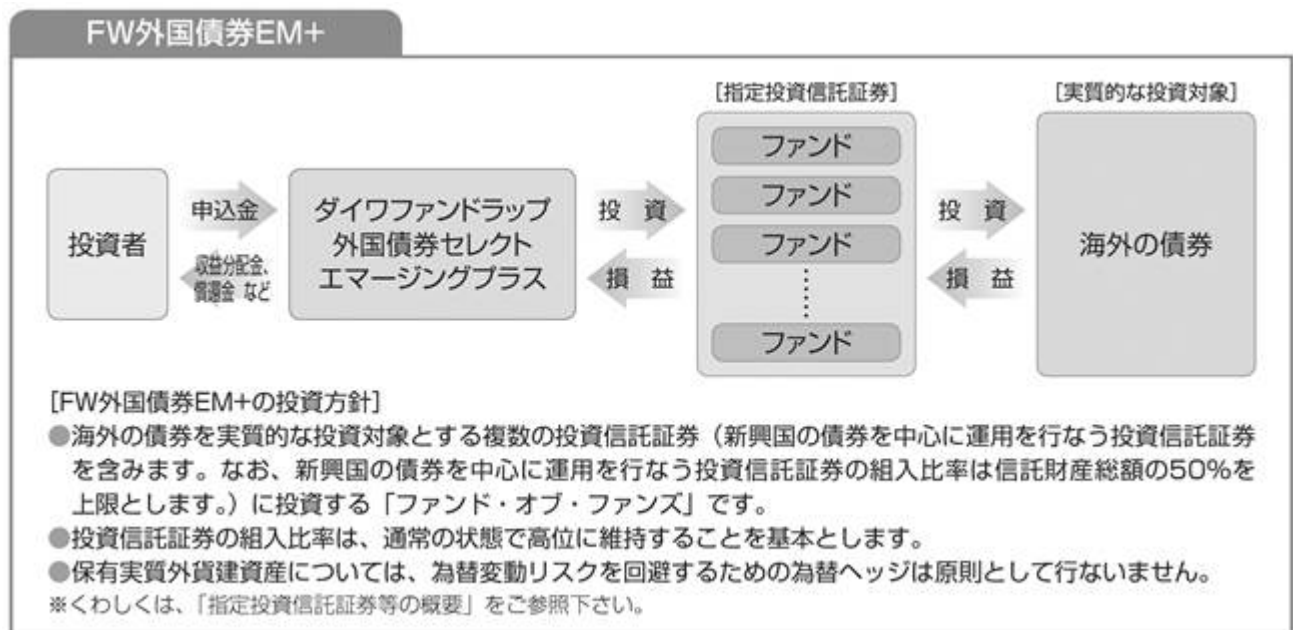
投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。



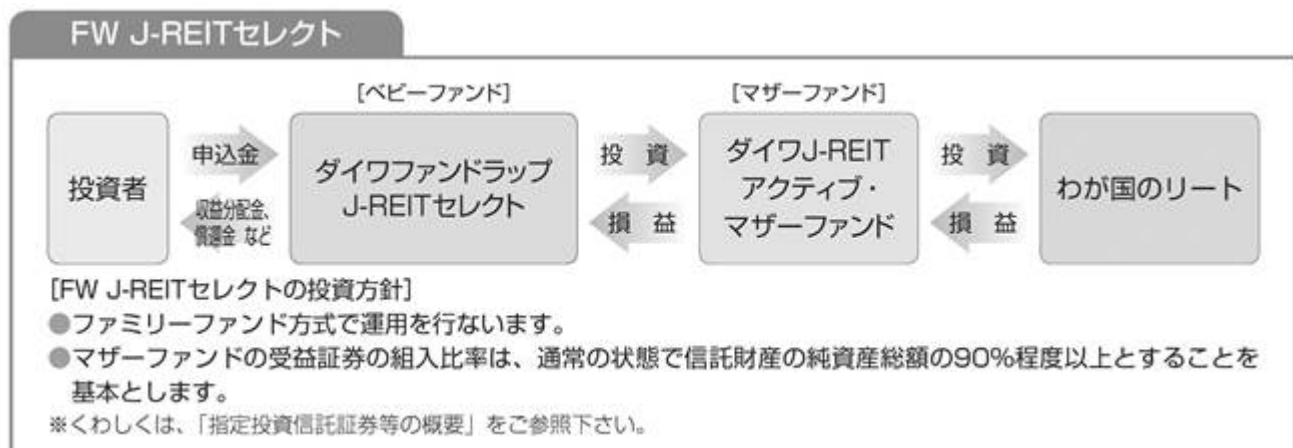
投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。



投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

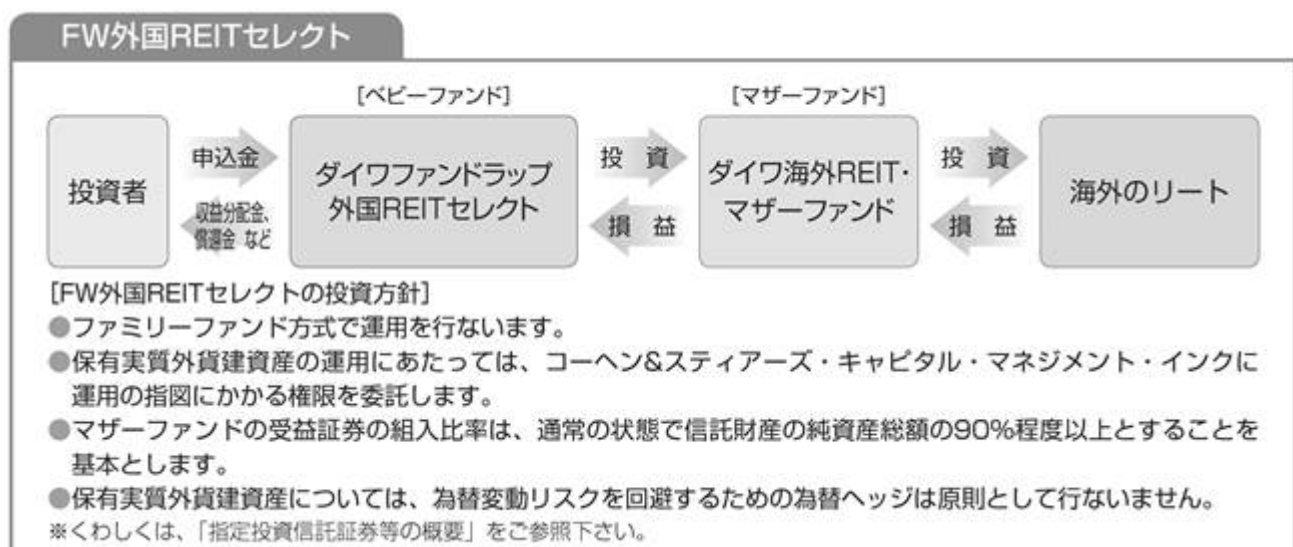


投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。



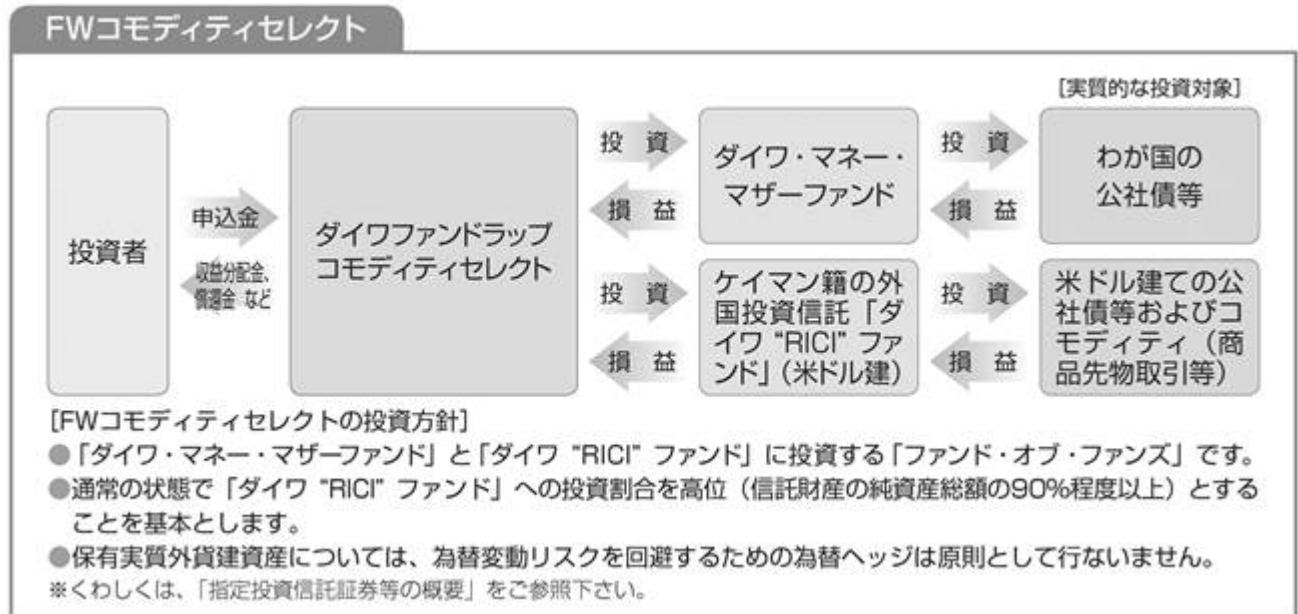
投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

< 略 >

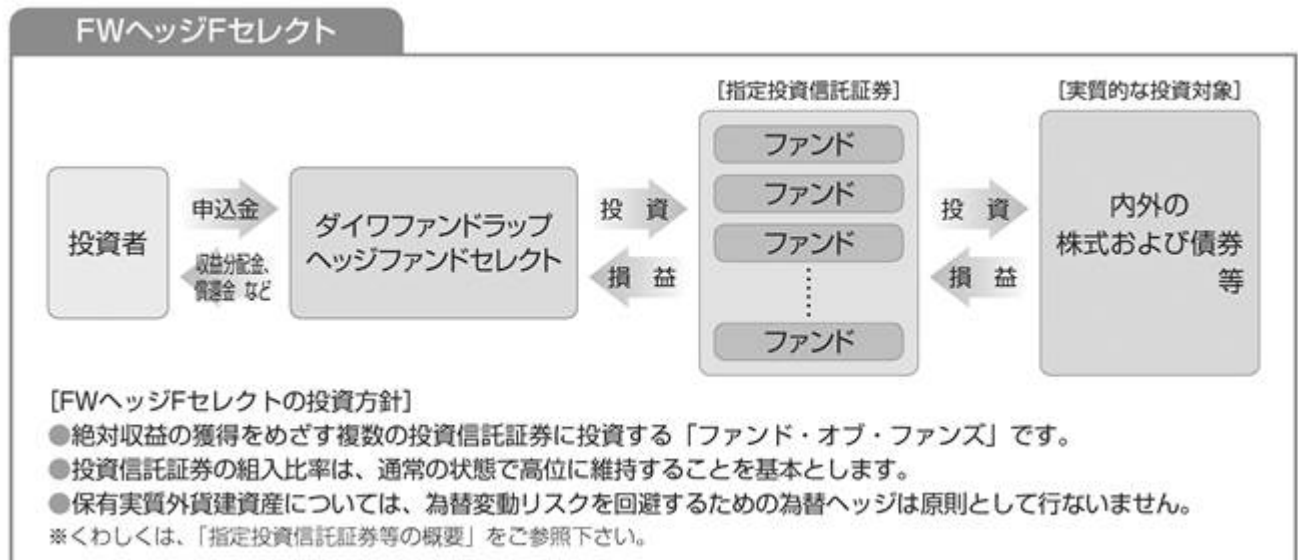


投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

< 略 >



< 略 >



投資対象となる「指定投資信託証券」については、「2 投資方針 (1) 投資方針 主要投資対象」をご参照ください。

< 略 >

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成27年6月末日現在） >

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成27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）
	G I 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 中小型株ファンド（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（F O F s用）（適格機関投資家専用）
	T & D / マイルストーン日本株ファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）
	大和住銀ニッポン中小型株ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
	ダイワ・スマート日本株ファンダメンタル・ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
	D I A M国内株式アクティブ市場型ファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）（注）
	S B I / アリオンツ日本株集中投資戦略ファンド（F O F s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）
	マニュアル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・ダイナミック日本債券ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
	明治安田日本債券アクティブ・ファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）（注）
	損保ジャパン日本興亜R M B Sファンド（適格機関投資家専用）（注）
	国内債券スイッチング戦略ファンド（F O F s用）（適格機関投資家私募）（注）
FW外国株式セレクト	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）
	ダイワ / ウェリントン・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
	ニッセイ / アリオンツ・欧州グロース株式ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
	T.ロウ・プライス・欧州株式オープン（F O F s用）（適格機関投資家専用）
	ダイワ・スマート米国株モメンタム・ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
	L M・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・ファンド（F O F s用）（適格機関投資家専用）（注）

FW外国株式EM+	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（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	ダイワ/ウエリントン・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	ニッセイ/アリアンツ・欧州グロース株式ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	T.ロウ・プライス・欧州株式オープン（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	ダイワ新興国株式ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	ダイワ・スマート米国株モメンタム・ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・ファンド（FOFs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）
FW外国債券セレクト	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）
	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）
	ダイワ欧州債券ファンド（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）
	グローバル・コア債券ファンド（適格機関投資家専用）（ケイマン籍、円建）（注）
	アイルランド籍の外国証券投資法人「ゴールドマン・サックス・インスティテューショナル・ファンズ・ピーエルシー」が発行する「ゴールドマン・サックス・グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオ（FOFs用）」の投資証券（米ドル建）
FW外国債券EM+	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）
	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）
	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）
	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）
	ダイワ欧州債券ファンド（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）
	グローバル・コア債券ファンド（適格機関投資家専用）（ケイマン籍、円建）（注）
	アイルランド籍の外国証券投資法人「ゴールドマン・サックス・インスティテューショナル・ファンズ・ピーエルシー」が発行する「ゴールドマン・サックス・グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオ（FOFs用）」の投資証券（米ドル建）
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）
	T & D米国金利戦略ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）
	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）
	ニッセイ・グローバル・ボンド・オポチュニティ（FOFs用）（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「ニューバーガー・バーマン・インベストメント・ファンズ・ピーエルシー」が発行する「ニューバーガー・バーマンUSロング・ショート・エクイティ・ファンド」の分配なし・円ヘッジクラス投資証券（円建）

上記は、平成27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があります。

各指定投資信託証券について、くわしくは「参考 指定投資信託証券等の概要」をご参照下さい。

(注)については、平成27年9月9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(FOFs用)(適格機関投資家専用)
	G I M日本株・ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)
	ダイワ好配当日本株投信Q(FOFs用)(適格機関投資家専用)
	J Flag 中小型株ファンド(FOFs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(F O F s用)(適格機関投資家専用)
	T & D / マイルストーン日本株ファンド(F O F s用)(適格機関投資家専用)
	大和住銀ニッポン中小型株ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)
	ダイワ・スマート日本株ファンダメンタル・ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)
	D I A M国内株式アクティブ市場型ファンド(F O F s用)(適格機関投資家専用)
	S B I / アリアンツ日本株集中投資戦略ファンド(F O F s用)(適格機関投資家専用)
	日本小型株フォーカス・ファンド(FOFs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(FOFs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(FOFs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(FOFs用)(適格機関投資家専用)
	ダイワ・ダイナミック日本債券ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)
	明治安田日本債券アクティブ・ファンド(F O F s用)(適格機関投資家専用)
	損保ジャパン日本興亜R M B Sファンド(適格機関投資家専用)
	国内債券スイッチング戦略ファンド(F O F s用)(適格機関投資家私募)
	NN国内債券ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)(注)
	ダイワ日本国債ファンド - ラダー20 - (FOFs用)(適格機関投資家専用)(注)

FW外国株式セレクト	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)
	ダイワ/ウエリントン・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	ニッセイ/アリアンツ・欧州グロース株式ファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	T.ロウ・プライス・欧州株式オープン(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	ダイワ・スマート米国株モメンタム・ファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・ファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	ダイワ・アジア・オセアニア先進国株式ファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)(注)
FW外国株式EM+	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)
	ダイワ/ウエリントン・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	ニッセイ/アリアンツ・欧州グロース株式ファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	T.ロウ・プライス・欧州株式オープン(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	ダイワ新興国株式ファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	ダイワ・スマート米国株モメンタム・ファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・ファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	ダイワ・アジア・オセアニア先進国株式ファンド(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)
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)
	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)
	ダイワ欧州債券ファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	ダイワ米国債券ファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)(注)
	ウエリントン・グローバル総合債券(除く日本)ファンド クラスS受益証券(円ヘッジ無、分配金有)(ケイマン籍、円建)
	グローバル・コア債券ファンド(適格機関投資家専用)(ケイマン籍、円建)
	ブルーベイ欧州総合債券ファンド(ケイマン籍、円建)(注)
	アイルランド籍の外国証券投資法人「ゴールドマン・サックス・インスティテューショナル・ファンズ・ピーエルシー」が発行する「グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオ(F0Fs用)」の投資証券(米ドル建)

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)
	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)
	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)
	ダイワ欧州債券ファンド (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	ダイワ米国債券ファンド (F0Fs用) (適格機関投資家専用) (注)
	ウエリントン・グローバル総合債券 (除く日本)ファンド クラスS 受益証券(円ヘッジ無、分配金有) (ケイマン籍、円建)
	グローバル・コア債券ファンド (適格機関投資家専用) (ケイマン籍、円建)
	ブルーベイ欧州総合債券ファンド (ケイマン籍、円建) (注)
	エマージング・マーケット債券ファンド (適格機関投資家専用) (ケイマン籍、円建) (注)
	アイルランド籍の外国証券投資法人「ゴールドマン・サックス・インスティテューショナル・ファンズ・ピーエルシー」が発行する「グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオ (F0Fs用)」の投資証券 (米ドル建)
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)
	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)
	ニッセイ・グローバル・ボンド・オポチュニティ (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	S M A M・国内株式ロングショートVファンド (F0Fs用) (適格機関投資家限定) (注)
	アイルランド籍の外国証券投資法人「ニューバーガー・パーマン・インベストメント・ファンズ・ピーエルシー」が発行する「ニューバーガー・パーマンUSロング・ショート・エクイティ・ファンド」の分配なし・円ヘッジクラス投資証券 (円建)

上記は、平成28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。

各指定投資信託証券について、くわしくは「参考 指定投資信託証券等の概要」をご参照下さい。

(注)については、平成28年3月9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。

< FW日本株式セレクト >

< 略 >

投資先ファンドの名称	S B I / アリアンツ日本株集中投資戦略ファンド (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 >

< FW日本債券セレクト >

< 略 >

投資先ファンドの名称	国内債券スイッチング戦略ファンド（FOFs用）（適格機関投資家私募）
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外国株式セレクト >

< 略 >

投資先ファンドの名称	LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・ファンド（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 >

< FW外国株式EM+ >

< 略 >

投資先ファンドの名称	LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・ファンド（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 >

< 略 >

< FW外国債券セレクト >

< 略 >

投資先ファンドの名称	ダイワ欧州債券ファンド（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	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、バークレイズ・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。
主要な投資対象	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。
委託会社等の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	グローバル・コア債券ファンド(適格機関投資家専用)(ケイマン籍、円建)
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社等の名称	< 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「ゴールドマン・サックス・インスティテューショナル・ファンズ・ピーエルシー」が発行する「 <u>ゴールドマン・サックス・グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオ (F O F s 用)</u> 」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 >
委託会社等の名称	< 略 >

< FW外国債券EM+ >

< 略 >

投資先ファンドの名称	ダイワ欧州債券ファンド(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	<u>ウエリントン・マネージメント・ポートフォリオ(ケイマン)</u> <u>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)</u>
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。
主要な投資対象	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。
委託会社等の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	グローバル・コア債券ファンド(適格機関投資家専用)(ケイマン籍、円建)
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社等の名称	< 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「ゴールドマン・サックス・インスティテューショナル・ファンズ・ピーエルシー」が発行する「 <u>ゴールドマン・サックス・グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオ (F O F s 用)</u> 」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 >
委託会社等の名称	< 略 >

< 略 >

<FWヘッジセレクト>

<略>

投資先ファンドの名称	ニッセイ・グローバル・ボンド・オポチュニティ（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>

<略>

平成27年9月8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は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>

投資対象ファンドの名称	ジャパンリアルエステイト投資法人
運用の基本方針・ 主要な投資対象	<略>
委託会社（資産運用会社） の名称	<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。

<FW日本株式セレクト>

<略>

投資先ファンドの名称	SBI/アリアンツ日本株集中投資戦略ファンド（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	日本小型株フォーカス・ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	このファンドは、「日本小型株フォーカス・マザーファンド」への投資を通じて、信託財産の中長期的な成長を図ることを目指して運用を行うことを基本とします。
主要な投資対象	日本小型株フォーカス・マザーファンドの受益証券を通じて、日本の株式に投資します。
委託会社の名称	BNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社

<FW日本債券セレクト>

<略>

投資先ファンドの名称	国内債券スイッチング戦略ファンド（FOFs用）（適格機関投資家私募）
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	NN国内債券ファンド（F0Fs 用）（適格機関投資家専用）
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目指して運用を行ないます。
主要な投資対象	NN国内債券マザーファンドの受益証券を通じて、主に日本の公社債に投資します。
委託会社の名称	NNインベストメント・パートナーズ株式会社

投資先ファンドの名称	ダイワ日本国債ファンド - ラダー20 - （F0Fs用）（適格機関投資家専用）
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。
主要な投資対象	ダイワ日本国債 - ラダー20 - 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ます。
委託会社の名称	大和証券投資信託委託株式会社

< FW外国株式セレクト >

< 略 >

投資先ファンドの名称	LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・ファンド（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	ダイワ・アジア・オセアニア先進国株式ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要な投資対象	世界の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（店頭登録予定を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）および不動産投資信託証券 先進国の株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券） 先進国の株式を対象とした株価指数先物取引 ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券 国内の債券
委託会社の名称	大和証券投資信託委託株式会社

< FW外国株式EM+ >

< 略 >

投資先ファンドの名称	LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・ファンド（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	ダイワ・アジア・オセアニア先進国株式ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要な投資対象	世界の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（店頭登録予定を含みます。）の株式（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）および不動産投資信託証券 先進国の株式の指数を対象指数としたETF（上場投資信託証券） 先進国の株式を対象とした株価指数先物取引 ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券 国内の債券
委託会社の名称	大和証券投資信託委託株式会社

< 略 >

< FW外国債券セレクト >

< 略 >

投資先ファンドの名称	ダイワ欧州債券ファンド（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	ダイワ米国債券ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	投資成果をシティ米国債インデックス（5年超・ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要な投資対象	米国の債券
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	ウエリントン・グローバル総合債券（除く日本）ファンド クラスS 受益証券(円ヘッジ無、分配金有)（ケイマン籍、円建）
運用の基本方針	ファンドは、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。
主要な投資対象	ファンドは、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。
委託会社等の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	グローバル・コア債券ファンド（適格機関投資家専用）（ケイマン籍、円建）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社等の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	ブルーベイ欧州総合債券ファンド（ケイマン籍、円建）
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。
主要な投資対象	パークレイズ・ユーロ総合債券インデックスをベンチマークに、主に欧州の投資適格債券への投資を行います。

委託会社等の名称	管理会社: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン & Co 受託会社: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・トラスト・カンパニー(ケイマン)・リミテッド 運用会社: ブルーベイ・アセット・マネジメント・エルエルピー 資産保管会社: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン & Co
----------	--

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「ゴールドマン・サックス・インスティテューショナル・ファンズ・ピーエルシー」が発行する「グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオ（FOFs用）」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 >
委託会社等の名称	< 略 >

< FW外国債券EM+ >

< 略 >

投資先ファンドの名称	ダイワ欧州債券ファンド（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	投資成果をシティ米国債インデックス（5年超・ヘッジなし・円ベース）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要な投資対象	米国の債券
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	ウエリントン・グローバル総合債券（除く日本）ファンド クラスS 受益証券(円ヘッジ無、分配金有)（ケイマン籍、円建）
運用の基本方針	ファンドは、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。
主要な投資対象	ファンドは、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。
委託会社等の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	グローバル・コア債券ファンド（適格機関投資家専用）（ケイマン籍、円建）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社等の名称	< 略 >

投資先ファンドの名称	ブルーベイ欧州総合債券ファンド（ケイマン籍、円建）
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。
主要な投資対象	パークレイズ・ユーロ総合債券インデックスをベンチマークに、主に欧州の投資適格債券への投資を行います。

委託会社等の名称	管理会社: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン & Co 受託会社: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・トラスト・カンパニー(ケイマン)・リミテッド 運用会社: ブルーベイ・アセット・マネジメント・エルエルピー 資産保管会社: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン & Co
----------	--

投資先ファンドの名称	エマージング・マーケット債券ファンド（適格機関投資家専用）（ケイマン籍、円建）
運用の基本方針	新興国の政府および政府機関等の発行するハードカレンシー建ての債券等を主要投資対象とし、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・ディバーシファイド）を上回る投資成果を目指します。
主要な投資対象	新興国の政府および政府機関等の発行するハードカレンシー建ての債券等を主要投資対象とします。
委託会社等の名称	投資運用会社: プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社 再委託先: PGIMインク、PGIMリミテッド トラスティー: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・トラスト・カンパニー アドミニストレーター: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン & Co. カストディアン: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン & Co. 監査法人: プライスウォーターハウスクーパース

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「ゴールドマン・サックス・インスティテューショナル・ファンズ・ピーエルシー」が発行する「グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオ（FOFs用）」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 >
委託会社等の名称	< 略 >

< 略 >

< FWヘッジFセレクト >

< 略 >

投資先ファンドの名称	ニッセイ・グローバル・ボンド・オポチュニティ（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	S M A M ・国内株式ロングショートVファンド（FOFs用）（適格機関投資家限定）
運用の基本方針	信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。
主要な投資対象	国内株式ロングショートV・マザーファンド（以下、「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とします。
委託会社の名称	三井住友アセットマネジメント株式会社

< 略 >

平成28年3月8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は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 >

投資対象ファンドの名称	ジャパンリアルエステイト投資法人
運用の基本方針・ 主要な投資対象	< 略 >
委託会社(資産運用会社) の名称	< 略 >

< FW外国REITセレクト >

投資対象ファンドの名称	サイモン・プロパティ・グループ
運用の基本方針・ 主要な投資対象	当銘柄は、米国最大級のREITであり、同国を中心とする商業施設（ショッピング・モール、アウトレット・センターなど）の取得・開発・管理・運営などを行なうことによって、収益の獲得と成長を目指します。保有物件は同国や日本を含むアジアなどにわたっております。
委託会社(資産運用会社) の名称	サイモン・プロパティ・グループ

(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27年6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27年6月末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27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27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。

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28年3月8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、ウエリントン・グローバル総合債券（除く日本）ファンドクラスS受益証券（円ヘッジ無、分配金有）（ケイマン籍、円建）、グローバル・コア債券ファンド（適格機関投資家専用）（ケイマン籍、円建）、ブルーベイ欧州総合債券ファンド（ケイマン籍、円建）、ゴールドマン・サックス・インスティテューショナル・ファンズ・ピーエルシー/グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオ（FOFs用）、エマージング・マーケット債券ファンド（適格機関投資家専用）（ケイマン籍、円建）、ニューバーガー・バーマン・インベストメント・ファンズ・ピーエルシー/ニューバーガー・バーマンUSロング・ショート・エクイティ・ファンド・分配なし・円ヘッジクラスを除きます。）

- ・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（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いません。
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いません。</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	<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>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。</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0.5724%(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。
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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>

2. G I M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	GIM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	<p>主として、マザーファンドの受益証券に投資します。</p> <p>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。</p>

マザーファンドの投資態度	<p>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。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・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株式運用ストラテジー」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。 <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。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。</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>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> <p>デリバティブ取引等を行う場合(マザーファンドを通じて実質的にデリバティブ取引等を行う場合を含みます。)は、デリバティブ取引等による投資についてのリスク量(以下「市場リスク量」といいます。)が、信託財産の純資産総額の80%以内となるよう管理するものとします。ただし、実際にはデリバティブ取引等を行っていない場合には、当該管理を行わないことができます。市場リスク量は、平成19年金融庁告示第59号「金融商品取引業者の市場リスク相当額、取引先リスク相当額及び基礎的リスク相当額の算出の基準等を定める件」における「市場リスク相当額」の算出方法のうち、内部管理モデル方式(バリュエーション・アット・リスク方式)による市場リスク相当額の算出方法を参考に算出するものとします。</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	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.702%(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。
ファンドの関係法人	委託会社:JPモルガン・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	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(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、通常の状態でも高位(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、通常の状態でも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、分配を行な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	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.486%(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。
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。

4. J Flag 中小型株ファンド(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	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>わが国の金融商品取引所上場株式の中から、委託者が管理する「投資除外銘柄」以外の上場株式を主な投資対象とします。「投資除外銘柄」は、一定時点の東京証券取引所市場第一部上場の銘柄中、時価総額上位300銘柄程度とし、委託者が定期的に更新を行ない管理します。なお、「投資除外銘柄」への該当は、取得時に判断されます。</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0.8856%（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。
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	<p>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。</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、上記のような運用ができない場合があります。</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>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。</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。 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	<p>信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.864%（税抜0.80%）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みます。）、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。</p>
ファンドの関係法人	<p>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</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。

6. T & D / マイルストーン日本株ファンド（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	信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所に上場する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に上場する株式を主要投資対象とし、信託財産の成長を目指します。 ボトム・アップ・アプローチにより、株価が企業価値に比べ割安水準にあり、投資価値が高いと判断される銘柄に投資を行います。 ボトム・アップ・アプローチとは、個別企業についての調査・分析をもとにした個別銘柄の選択によってポートフォリオを構築する投資手法です。 株式以外の資産への投資割合は、原則として、投資信託財産総額の50%以下とします。 運用にあたっては投資顧問会社（マイルストーンアセットマネジメント株式会社）の助言を受けません。 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用が行われないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資割合には制限を設けません。 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。 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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。 外貨建資産への投資は行いません。 デリバティブ取引はヘッジ目的に限定します。</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、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、分配を行わないことがあります。
信託期間	無期限(平成26年9月9日当初設定)
決算日	毎年4月25日(休業日の場合翌営業日)
信託財産留保額	換金申込受付日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額
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0.81%(税抜0.75%)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。 委託者の受ける報酬には、投資顧問会社に支払う投資顧問料(年率0.4428%(税抜0.41%))を含みます。
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。

7. 大和住銀ニッポン中小型株ファンド(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	信託財産の成長を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	日本中小型株マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の株式のうち中小型株を主要投資対象とします。 徹底的なリサーチに基づくボトムアップ・アプローチにより、「成長の持続性等を考慮したファンダメンタルズ価値に対して株価水準が割安と判断する銘柄」に投資します。 わが国の株式(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。 設定日からポートフォリオの構築までの期間、大量の追加設定・解約が発生したとき、資金動向、市況動向、残存元本等によっては、ならびに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	わが国の株式のうち中小型株を主要投資対象とします。 徹底的なリサーチに基づくボトムアップ・アプローチにより、「成長の持続性等を考慮したファンダメンタルズ価値に対して株価水準が割安と判断する銘柄」に投資します。 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。 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。 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。 外貨建資産への実質投資は行いません。 デリバティブ取引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、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の範囲内とします。 収益分配金額は、基準価額の水準等を勘案して収益の分配額を決定します。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27年3月9日当初設定)
決算日	毎年3月8日(第1計算期間は平成28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0.729%(税抜0.675%)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。

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。

8. ダイワ・スマート日本株ファンダメンタル・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(上場予定を含みます。以下同じ。)を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、わが国の金融商品取引所上場株式を投資対象とし、独自のモデルに基づいた運用を行ない、信託財産の成長をめざします。</p> <p>当ファンドにおける独自のモデルとは、ポートフォリオの銘柄選定・ウェイト付けを個別企業のファンダメンタルズ(売上高、キャッシュフロー、利益などの財務指標)を用いて定量的に算出するモデルのことをいいます。</p> <p>株式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>運用の効率化を図るため、わが国の株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数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>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>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>
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>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、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27年3月10日当初設定)
決算日	毎年6月15日(休業日の場合翌営業日)(第1計算期間は平成27年6月15日(休業日の場合翌営業日)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0.24948%(税抜0.231%)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。
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。

9. D I A M国内株式アクティブ市場型ファンド(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	信託財産の成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式(上場予定を含みます。以下、同じ。)

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、信託財産の中長期的な成長を図ることを目的として、積極的な運用を行います。</p> <p>運用にあたっては、企業調査に基づく個別銘柄選定(ボトムアップアプローチ)とマクロ環境や相場環境の変化等に注目した機動的な運用(トップダウンアプローチ)を併用します。</p> <p>個別銘柄の選定にあたっては、企業調査に基づくファンダメンタルズ分析に加え、みずほ第一フィナンシャルテクノロジー社独自の定量モデルも活用し、企業の成長力や株価のバリュエーション等の観点から、魅力度の高い銘柄を選定します。</p> <p>株式の組入比率は、原則として高位を維持します。</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出来ない場合があります。</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>
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>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、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> <p>有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引の利用はヘッジ目的に限定します。</p> <p>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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会の規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会の規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益の分配	<p>経費控除後の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。</p> <p>委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。</p> <p>留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p>
信託期間	無期限(平成27年9月9日当初設定)
決算日	毎年2月12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率0.5238%(税抜0.485%)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。
ファンドの関係法人	委託会社: DIAMアセットマネジメント株式会社 受託会社: みずほ信託銀行株式会社
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. SBI/アリアンツ日本株集中投資戦略ファンド(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	ファミリーファンド方式により、信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	SBI/アリアンツ日本株集中投資戦略・マザーファンド(以下「マザーファンド」)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、わが国の金融商品取引所に上場する企業のうち、企業の本源的価値に比べ、株価が過小評価されていると見込まれる20～30銘柄程度を選定し集中投資することにより、超過リターンを目指します。</p> <p>組入銘柄選定にあたっては、原則として下記のようなポイントに着目します。</p> <p>(1)カリスト: 構造的変化・株主還元計画・収益サプライズ (2)認識のギャップ: 企業価値・競合他社に比べて割安 (3)トレンドライン: 長期成長性・特有の利益創出力 (4)経営の質</p> <p>当ファンドはTOPIX(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークに対して超過収益を目指して運用を行います。</p> <p>マザーファンドの運用に関しては、アリアンツ・グローバル・インベスターズ・ジャパン株式会社より投資助言を受けます。</p> <p>株式の実質組入比率は、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>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。</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に上場する企業のうち、企業の本源的価値に比べ、株価が過小評価されていると見込まれる20～30銘柄程度を選定し集中投資することにより、超過リターンを目指します。</p> <p>組入銘柄選定にあたっては、原則として下記のようなポイントに着目します。</p> <p>(1)カリスト: 構造的変化・株主還元計画・収益サプライズ (2)認識のギャップ: 企業価値・競合他社に比べて割安 (3)トレンドライン: 長期成長性・特有の利益創出力 (4)経営の質</p> <p>本ファンドはTOPIX(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークに対して超過収益を目指して運用を行います。</p> <p>本ファンドの運用に関しては、アリアンツ・グローバル・インベスターズ・ジャパン株式会社より投資助言を受けます。</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90%程度以上に維持することを基本とします。</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、上記の運用が行われないことがあります。</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。</p> <p>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10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資は、行いません。</p> <p>デリバティブ商品への実質投資は、行いません。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益の分配	<p>分配対象額の範囲は、経費控除後の配当等収益(マザーファンドにおけるみなし配当等収益を含みます。)と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</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27年9月9日当初設定)
決算日	<p>毎年3月28日(休業日の場合翌営業日)</p> <p>(第1計算期間は平成28年3月28日(休業日の場合翌営業日)まで)</p>
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0.5184%(税抜0.48%)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>
ファンドの関係法人	<p>委託会社: SBI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>
------------	--

11. 日本小型株フォーカス・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	このファンドは、「日本小型株フォーカス・マザーファンド」(以下、マザーファンドといたします。)への投資を通じて、信託財産の中長期的な成長を図ることを目指して運用を行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
投資態度	マザーファンド受益証券への投資を通じ、以下2点を目指します。 ファンダメンタル調査を通じて市場の非効率性を見出し、継続的に超過収益を得ることを目指します。 ボトムアップによる銘柄選択を主な源泉とした超過収益の獲得を運用目標とします。1銘柄当たりのウェイトの上限は10%とします。
マザーファンドの投資態度	ファンダメンタル調査を通じて市場の非効率性を見出し、継続的に超過収益を得ることを目指します。 ボトムアップによる銘柄選択を主な源泉とした超過収益の獲得を運用目標とします。1銘柄当たりのウェイトの上限は10%とします。
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制限を設けません。 マザーファンドの受益証券を除く投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。 為替予約は行いません。
収益の分配	分配対象額は、配当収益及び売買益とします。 原則として、基準価額の水準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、分配を行わないことがあります。
信託期間	無期限
決算日	毎年2月15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0.7290%(税抜0.6750%)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。
ファンドの関係法人	委託会社:BNY Mellon・アセット・マネジメント・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	-
ベンチマークについて	-

12. 東京海上日本債ファンド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	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」といたします。)の受益証券

投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p>
マザーファンドの投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>イールド選択(金利選択)</p> <p>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。</p> <p>*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。</p> <p>スプレッド選択</p> <p>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。</p> <p>銘柄選択</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<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。(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。)</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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、信託財産の純資産総額の20%以下とします。</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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</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。</p> <p>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。</p>
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以下の率を乗じて得た額とします。 500億円以下の部分に対して 年0.324%(税抜0.30%) 500億円超1,000億円以下の部分に対して 年0.2646%(税抜0.245%) 1,000億円超の部分に対して 年0.2106%(税抜0.195%) 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。
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株式会社 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、野村證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、野村證券の知的財産です。野村證券は、当ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。

13. 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)

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、債券先物取引やクレジット・デリバティブ取引等のデリバティブ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	<p>信託報酬の総額は、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。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・純資産総額500億円以内年0.324% (税抜0.30%) ・純資産総額500億円超1,000億円以内部分年0.270% (税抜0.25%) ・純資産総額1,000億円超部分年0.2106% (税抜0.195%) <p>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。</p>
ファンドの 関係法人	<p>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</p>
ベンチマーク	NOMURA-BPI総合
ベンチマーク について	<p>NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社の金融工学等研究部門が発表しているわが国の債券市場全体の動向を反映する投資収益指数(パフォーマンス)で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI総合は、同社の知的財産であり、同指数に関する一切の権利は同社に帰属します。野村證券株式会社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。</p>

14. 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)

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	<p>信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.432%(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</p> <p>ず。</p>
ファンドの 関係法人	<p>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</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。

15. ダイワ・ダイナミック日本債券ファンド（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	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	わが国の債券
投資態度	<p>主として、わが国の債券を投資対象とし、債券市場よりデュレーションの長いポートフォリオを構築することにより、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざします。</p> <p>組入れる債券（国債を除きます。）の格付けは、取得時においてBBB格相当以上（R&I、JCR、S&P、フィッチのいずれかでBBB-以上またはムーディーズでBaa3以上）とします。</p> <p>債券への投資に代えて、CDS取引を利用することがあります。</p> <p>上記にかかわらず、イールドカーブの形状変化や債券先物のヒストリカル・ボラティリティ等に注目して債券市場の歪みが拡大すると判断される場合には、ファンドのデュレーションを短期化することがあります。</p> <p>債券の組入比率は、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>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、債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。また、債券先物取引等の売建玉が債券の組入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> <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>
主な投資制限	<p>株式への投資は、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等により取得したものにかぎります。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、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26年9月10日当初設定）
決算日	毎年6月15日（第1計算期間は、平成27年6月15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、純資産総額に対して年率0.3672%（税抜0.34%）以内とします。</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26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。</p> <p>（新発10年国債の利回りが）</p> <p>イ. 2%未満の場合 …年率0.1944%（税抜0.18%）</p> <p>ロ. 2%以上3%未満の場合 …年率0.2376%（税抜0.22%）</p> <p>ハ. 3%以上4%未満の場合 …年率0.2808%（税抜0.26%）</p> <p>ニ. 4%以上5%未満の場合 …年率0.3240%（税抜0.30%）</p> <p>ホ. 5%以上の場合 …年率0.3672%（税抜0.34%）</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。

16. 明治安田日本債券アクティブ・ファンド（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	信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。
主要投資対象	邦貨建ての国債、政府保証債、地方債、利付金融債、社債等

投資態度	<p>「NOMURA-BPI総合」をベンチマークとして信託財産の成長を目指します。</p> <p>投資対象は、国債、地方債および特別の法律により法人の発行する債券ならびに委託会社が別に定める格付会社のいずれかより取得時においてBBB格以上の格付けを有する債券およびそれと同等の信用度を有すると判断した債券とします。</p> <p>マクロ経済分析をベースとした金利の方向性予測等に基づき、市況動向やリスク分散等を勘案して、ポートフォリオの見直しを随時行います。</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デリバティブ取引等を行うことができます。</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、転換社債の転換およ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>同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</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・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</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27年9月9日当初設定）
決算日	<p>毎年2月26日および8月26日（休業日の場合翌営業日）</p> <p>（第1計算期間は平成28年2月26日（休業日の場合翌営業日）まで）</p>
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0.3024%（税抜0.28%）以内とします。</p> <p>前の信託報酬率は、毎月10日（休業日の場合翌営業日）における新発10年固定利付国債の利回り（日本相互証券株式会社発表の終値、未発表の場合は直近終値）に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。</p> <p>（新発10年固定利付国債の利回りが）</p> <p>イ. 1%未満の場合 …年率0.1944%（税抜0.18%）</p> <p>ロ. 1%以上の場合 …次に定める率</p> <ul style="list-style-type: none"> ・純資産総額500億円未満年0.3024%（税抜0.28%） ・純資産総額500億円以上1,000億円未満部分年0.2484%（税抜0.23%） ・純資産総額1,000億円以上部分年0.1944%（税抜0.18%） <p>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>
ファンドの関係法人	<p>委託会社：明治安田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	NOMURA - BPI(総合)
ベンチマークについて	<p>NOMURA - BPI(野村ボンド・パフォーマンス・インデックス)(総合)とは、野村證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、野村證券の知的財産です。野村證券は、当ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。</p>

17. 損保ジャパン日本興亜RMB S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	中長期的な信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目的とします。
主要投資対象	RMB SおよびMBSを主要投資対象とします。
投資態度	<p>主としてRMB SおよびMBSに分散投資し、ベンチマークであるNOMURA - BPI・MBSインデックスを上回る収益率の獲得およびリスクの分散を図ることを目指します。</p> <p>国債、地方債・政府保証債以外の金融債・事業債・ユーロ円債・円建外債等については、S&P、ムーディーズ社、格付投資情報センター、日本格付研究所のうちいずれかからBBB-相当以上の格付けを取得している銘柄を投資対象とします。</p> <p>各種計量モデルを用いて、複雑で高度な数値分析が必要とされるRMB S分析を行い、割安度が高い銘柄を選定するRMB S戦略によりポートフォリオの組入れ銘柄を決定します。</p> <p>運用期間を通じて、ポートフォリオの見直しを随時行い、個別組入銘柄変更やデュレーション調整等を行います。</p> <p>資金動向、市況動向その他特殊な状況等によっては、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	外貨建資産への投資は行いません。

収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子、配当収入と売買益(評価損益を含みます。)等の全額とします。 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等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。 留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、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27年9月8日当初設定)
決算日	毎年9月5日(休業日の場合翌営業日) (第1計算期間は平成28年9月5日まで)
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0.3672%(税抜0.34%)以内とします。 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27年10月13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) イ.1%未満の場合 ...年率0.1944%(税抜0.18%) ロ.1%以上2%未満の場合 ...年率0.2376%(税抜0.22%) ハ.2%以上3%未満の場合 ...年率0.2808%(税抜0.26%) ニ.3%以上4%未満の場合 ...年率0.3240%(税抜0.30%) ホ.4%以上の場合 ...年率0.3672%(税抜0.34%) 他に監査費用、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。</p>
ファンドの関係法人	委託会社: 損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社 受託会社: みずほ信託銀行株式会社
ベンチマーク	NOMURA - BPI・MBSインデックス
ベンチマークについて	NOMURA - BPI・MBSインデックスは、野村証券が公表する国内で発行された公募MBSの市場全体の動向を表す投資収益指数です。NOMURA - BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

18. 国内債券スイッチング戦略ファンド(FOFs用)(適格機関投資家私募)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	安定的な収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	わが国の国債
投資態度	<p>主としてわが国の国債に投資を行い、安定的な収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。 運用にあたっては、残存期間20年程度以下の年限で構成されるラダー型国債ポートフォリオの組み入れを高位とすることを基本としつつ、金利上昇が予測される局面では短期国債や短期金融資産などの低リスク資産の配分比率を高めることにより、金利上昇時の値下がりを抑制することを目指します。 ラダー型国債ポートフォリオおよび低リスク資産への配分比率の決定は、原則として、所定の運用モデル等に基づき行います。 当ファンドの運用にあたっては、みずほ信託銀行株式会社から投資助言および情報提供を受けます。 当ファンドの資金動向、市況動向等によっては、また、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。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とし、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、)の行使により取得したものに限り、</p> <p>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%以下とします。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%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>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益の分配	<p>分配対象額は、繰越分を含めた利子・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。</p> <p>分配金額は、基準価額水準や市況動向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27年9月8日当初設定)
決算日	<p>毎年3月5日(休業日の場合翌営業日)</p> <p>(第1計算期間は平成28年3月5日(休業日の場合翌営業日)まで)</p>
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0.3672%(税抜0.34%)以内とします。</p> <p>前 月の信託報酬率は、毎月10日時点(休業日の場合翌営業日)(当初設定日から平成27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の終値)に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。</p> <p>(新発10年国債の利回りが)</p> <p>イ. 2%未満の場合 ...年率0.1944%(税抜0.18%)</p> <p>ロ. 2%以上3%未満の場合 ...年率0.2376%(税抜0.22%)</p> <p>ハ. 3%以上4%未満の場合 ...年率0.2808%(税抜0.26%)</p> <p>ニ. 4%以上5%未満の場合 ...年率0.3240%(税抜0.30%)</p> <p>ホ. 5%以上の場合 ...年率0.3672%(税抜0.34%)</p> <p>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>
ファンドの関係法人	<p>委託会社: 新光投信株式会社</p> <p>受託会社: みずほ信託銀行株式会社</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。

19. NN国内債券ファンド(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	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長を目指して運用を行ないます。
主要投資対象	NN国内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>マザーファンドの受益証券を通じ、主に日本の公社債に投資します。</p> <p>ポートフォリオの構成にあたっては少数銘柄に偏ることなく分散投資に留意し、トータルリターンの上を目指すとともに、リスクの低減に努めます。</p> <p>債券への実質的な投資割合は高位に保ちます。</p> <p>ポートフォリオに組入れる債券は原則として、投資適格債券とします。</p> <p>委託会社が別に定める格付会社のいずれかにより取得時においてBBB格相当以上の格付けを有する債券および同等の信用度を有すると判断した債券に投資します。</p> <p>債券の投資プロセスは、</p> <p>(1) イールドカーブの分析とポジショニングの決定</p> <p>(2) 銘柄の選定</p> <p>(3) リスクコントロール</p> <p>の3つのステップで行ないます。</p> <p>NOMURA-BPI(総合)をベンチマークとします。</p> <p>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。</p>

マザーファンドの投資態度	<p>主に日本の公社債に投資します。 ポートフォリオの構成にあたっては少数銘柄に偏ることなく分散投資に留意し、トータルリターンの上を目指すとともに、リスクの低減に努めます。 債券への投資割合は高位に保ちます。</p> <p>ポートフォリオに組入れる債券は原則として、投資適格債券とします。 委託会社が別に定める格付会社のいずれかにより取得時においてBBB格相当以上の格付けを有する債券および同等の信用度を有すると判断した債券に投資します。 債券の投資プロセスは、 (1) イールドカーブの分析とポジショニングの決定 (2) 銘柄の選定 (3) リスクコントロール の3つのステップで行ないます。 NOMURA-BPI(総合)をベンチマークとします。 資金動向や市況動向によっては、上記のような運用を行なわない場合があります。</p>						
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への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 外貨建資産には投資しません。 デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。</p>						
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。 分配対象額の範囲は、経費控除後の利息・配当収入(繰越分を含みます。)および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 収益分配金額は、委託者が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合は分配を行なわないこともあります。 収益分配にあてず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き運用を行ないます。</p>						
信託期間	無期限(平成28年3月8日当初設定)						
決算日	<p>毎年2月26日(休業日の場合は翌営業日) (第1計算期間は平成29年2月27日(休業日の場合は翌営業日)まで)</p>						
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0.3024%(税抜き0.28%)以内とします。 前の信託報酬率は、毎月10日(休業日の場合は翌営業日)(当初設定日から平成28年4月10日(休業日の場合は翌営業日)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年固定利付国債の利回り(日本相互証券株式会社発表の終値、未発表の場合は直近終値)に応じて、純資産総額に対して以下の率とします。</p> <p>(新発10年固定利付国債の利回りが) イ. 1%未満の場合 ...年率0.1944%(税抜き0.18%) ロ. 1%以上の場合 ...次に定める率</p> <table border="0"> <tr> <td>・純資産総額500億円未満部分</td> <td>年率0.3024%(税抜き0.28%)</td> </tr> <tr> <td>・純資産総額500億円以上1,000億円未満部分</td> <td>年率0.2484%(税抜き0.23%)</td> </tr> <tr> <td>・純資産総額1,000億円以上部分</td> <td>年率0.1944%(税抜き0.18%)</td> </tr> </table>	・純資産総額500億円未満部分	年率0.3024%(税抜き0.28%)	・純資産総額500億円以上1,000億円未満部分	年率0.2484%(税抜き0.23%)	・純資産総額1,000億円以上部分	年率0.1944%(税抜き0.18%)
・純資産総額500億円未満部分	年率0.3024%(税抜き0.28%)						
・純資産総額500億円以上1,000億円未満部分	年率0.2484%(税抜き0.23%)						
・純資産総額1,000億円以上部分	年率0.1944%(税抜き0.18%)						
ファンドの関係法人	<p>委託会社: NNインベストメント・パートナーズ株式会社 受託会社: 三井住友信託銀行株式会社</p>						
ベンチマーク	NOMURA-BPI(総合)						
ベンチマークについて	<p>NOMURA-BPI(野村債券・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。</p>						

20. ダイワ日本国債ファンド - ラダー20 - (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	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 - ラダー20 - 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20年程度までの国債を、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>ただし、国債の利回り状況によっては各残存期間の全てに投資するとは限りません。このため、各残存期間の投資金額が同程度とならない場合があります。</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、国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 に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20年程度までの国債を、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>ただし、国債の利回り状況によっては各残存期間の全てに投資するとは限りません。このため、各残存期間の投資金額が同程度とならない場合があります。</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、国債の組入総額ならびに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>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、転換社債の転換およ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 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>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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、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28年3月9日当初設定)
決算日	毎年3月15日(第1計算期間は、平成29年3月15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、純資産総額に対して年率0.31428%(税抜0.291%)以内とします。</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28年3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。</p> <p>(新発10年国債の利回りが)</p> <p>イ. 2%未満の場合 ...年率0.14148%(税抜0.131%)</p> <p>ロ. 2%以上3%未満の場合 ...年率0.18468%(税抜0.171%)</p> <p>ハ. 3%以上4%未満の場合 ...年率0.22788%(税抜0.211%)</p> <p>ニ. 4%以上5%未満の場合 ...年率0.27108%(税抜0.251%)</p> <p>ホ. 5%以上の場合 ...年率0.31428%(税抜0.291%)</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。

21. 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	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。 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。 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。
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	信託報酬の総額は、投資信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額とします。 ・500億円以下の部分に対して年0.9072%(税抜0.84%) ・500億円超1,000億円以下の部分に対して年0.783%(税抜0.725%) ・1,000億円超の部分に対して年0.567%(税抜0.525%) 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。
信託財産留保額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.20%の率を乗じて得た額
ファンドの関係法人	委託会社:MFSインベストメント・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: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
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	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。 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。

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/ポストン・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/ポストン・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/ポストン・カンパニー・米国中型株 マザーファンド></p> <p>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。</p> <p>運用にあたっては、「ザ・ポストン・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。</p> <p>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。</p> <p>株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。</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> <p><ニッセイ米国配当成長株 マザーファンド></p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。</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>
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>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。</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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>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。</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> <p>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> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</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。)等の全額とします。</p> <p>分配金額は、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(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下記の率を乗じて得た額とします。</p> <p>500億円以下の部分年率0.94608%(税抜0.876%)</p> <p>500億円超700億円以下の部分年率0.78948%(税抜0.731%)</p> <p>700億円超の部分年率0.71388%(税抜0.661%)</p> <p>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>
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</p> <p>受託会社:三井住友信託銀行株式会社</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。

23. ダイワノウエリントン・グローバル・オポチュニティーズ・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	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	世界(日本を除く、以下同じ)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。また、DR(預託証券)を含みます。)
投資態度	<p>主として、世界の株式等に投資し、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。</p> <p>株式等にはDR、REIT、ETF、新株予約権証券および転換社債を含みます。</p> <p>日本を除く世界の企業の中から、主として投下資本利益率の維持・改善に焦点を当て、将来の投下資本利益率を考慮したうえで割安であると考えられる企業の株式等に投資します。</p> <p>外貨建資産の運用にあたっては、ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピーに運用の指図にかかる権限を委託します。</p> <p>株式等の組入比率は、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>
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>外貨建資産への投資割合には、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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、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26年9月10日当初設定)
決算日	毎年6月15日(第1計算期間は平成27年6月15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1.0584%(税抜0.98%)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。
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> <p>投資顧問会社:ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー</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。
------------	-------------

24．ニッセイ／アリアンツ・欧州グロース株式ファンド（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／アリアンツ・欧州グロース株式 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、ニッセイ／アリアンツ・欧州グロース株式 マザーファンドへの投資を通じて、実質的に欧州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>MSCI ヨーロッパ・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。</p> <p>上記マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。</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>主として欧州の株式の中から、長期にわたり高い利益成長が期待できる企業に長期投資を行います。</p> <p>銘柄の選択にあたっては、利益やキャッシュフローの成長力、競争上の優位性や高い参入障壁などのクオリティおよびバリュエーションに着目し、流動性も勘案します。</p> <p>運用にあたっては、アリアンツ・グローバル・インベスターズGmbH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。</p> <p>MSCI ヨーロッパ・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。</p> <p>株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。</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>
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>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。</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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>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。</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。</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> <p>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> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の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。</p> <p>分配金額は、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9月9日当初設定)
決算日	毎年3月5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率0.89208%(税抜0.826%)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。

ファンドの 関係法人	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 マザーファンドの投資顧問会社:アリアンツ・グローバル・インベスターズGmbH
ベンチマーク	MSCI ヨーロッパ・インデックス(円換算ベース)
ベンチマーク について	MSCI ヨーロッパ・インデックスは、MSCI Inc. が公表している指数です。同指数に関する著作権、知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。 なお、「円換算ベース」とは同指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

25. T.ロウ・プライス・欧州株式オープン(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	この投資信託は、信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	欧州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
投資態度	マザーファンドの受益証券への投資を通じて、主に欧州の金融商品取引所に上場する株式等へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長を目指します。 ④⑨ 主な事業活動を欧州地域で行っている欧州地域以外の金融商品取引所に上場する株式等にも投資する場合があります。また、株式以外に、DR、REIT等にも投資する場合があります。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。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。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	主に欧州の金融商品取引所に上場する株式等へ投資することにより、中長期的な信託財産の成長を目指します。 ④⑨ 主な事業活動を欧州地域で行っている欧州地域以外の金融商品取引所に上場する株式等にも投資する場合があります。また、株式以外に、DR、REIT等にも投資する場合があります。ボトムアップによる個々の企業のファンダメンタルズ分析により銘柄の選定を行います。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。運用指図にかかる権限をT.ロウ・プライス・インターナショナル・リミテッドへ委託します。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。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、原則として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。 投資信託証券(マザーファンドおよび金融商品取引所上場の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。 デリバティブ取引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。 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。
信託期間	無期限(平成26年9月10日当初設定)
決算日	毎年3、9月の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	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.8964%(税抜0.83%)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。
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	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. ダイワ・スマート米国株モメンタム・ファンド(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	米国の金融商品取引所上場および店頭登録(上場予定および店頭登録予定を含みます。)の株式(DR(預託証券)を含みます。)および不動産投資信託証券(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をいいます。)
投資態度	<p>主として、米国の株式等()を投資対象とし、独自のモデルに基づいた運用を行ない、信託財産の成長をめざします。</p> <p>当ファンドにおける米国の株式等とは、米国の金融商品取引所上場および店頭登録(上場予定および店頭登録予定を含みます。)の株式(DR(預託証券)を含みます。)および不動産投資信託証券(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をいいます。)をいいます。</p> <p>当ファンドにおける独自のモデルとは、ポートフォリオの銘柄選定・ウェイト付けを個別企業の株価の値動き(モメンタム)やROE等を用いて定量的に算出するモデルのことをいいます。</p> <p>株式等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>運用の効率化を図るため、株価指数先物取引等を利用することがあります。このため、株式等の組入総額と株価指数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> <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>
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>新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。</p> <p>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、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、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27年3月10日当初設定)
決算日	毎年6月15日(第1計算期間は、平成27年6月15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率0.31428%(税抜0.291%)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。
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。

27. LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・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	<p>信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。</p> <p>当ファンドは、主に「LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、主に米国の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている中型以下の企業の株式に投資することにより、信託財産の長期的な成長を目指します。</p>
主要投資対象	LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・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

投資態度	<p>LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指します。</p> <p>LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロースマザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定して行うものとします。</p> <p>資金動向や市場動向によっては、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>主として、米国の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている中型以下の企業の株式に投資します。</p> <p>個別企業のファンダメンタルズ分析に基づき、競争力、収益性、財務の安定性に優れ、成長余力が大きいと考えられる銘柄を選定します。</p> <p>業種および銘柄の分散とポートフォリオの流動性に配慮してポートフォリオを構築します。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。</p> <p>デリバティブ取引は、ヘッジ目的に限定して行うものとします。</p> <p>資金動向や市場動向によっては、前記のような運用ができない場合があります。</p> <p>クリアブリッジ・インベストメンツ・エルエルシーに、運用の指図に関する権限を委託します。</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>新株引受権証券等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。</p> <p>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10%以内とします。</p> <p>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5%以内とします。</p> <p>投資信託証券(マザーファンド受益証券及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%以内とします。</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> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</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。</p> <p>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。</p>
信託期間	無期限(平成27年9月8日当初設定)
決算日	毎年5月25日(休業日の場合翌営業日) (第1計算期間は平成28年5月25日まで)
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0.8478%(税抜年0.785%)の率を乗じて得た額とします。</p> <p>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>
ファンドの関係法人	<p>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</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: クリアブリッジ・インベストメンツ・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。

28. ダイワ・アジア・オセアニア先進国株式ファンド(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	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要投資対象	<p>世界の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)および店頭登録(店頭登録予定を含みます。)の株式(DR(預託証券)を含みます。以下同じ。)および不動産投資信託証券</p> <p>先進国の株式の指数を対象指数としたETF(上場投資信託証券)</p> <p>先進国の株式を対象とした株価指数先物取引</p> <p>ダイワ・マネー・マザーファンドの受益証券</p> <p>国内の債券</p>

投資態度	<p>主として、アジア・オセアニア地域の先進国(日本を除きます。以下同じ。)の株式に投資し、アジア・オセアニア地域の先進国の株式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>先進国の株式の指数を対象指数としたETFに投資することがあります。</p> <p>運用の効率化をはかるため、先進国の株式を対象とした株価指数先物取引を利用することがあります。このため、アジア・オセアニア地域の先進国の株式および先進国の株式の指数を対象指数としたETFの組入総額と先進国の株式を対象とした株価指数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> <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>わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。</p> <p>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。</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>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>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。</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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、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28年3月9日当初設定)
決算日	毎年3月15日(第1計算期間は、平成29年3月15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0.31428%(税抜0.291%)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。
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。

29. ダイワ新興国株式ファンド(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	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	新興国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

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、新興国株式、新興国株式を対象とした株価指数先物取引、新興国株式の指数を対象指数としたETFおよび国内の債券に投資し、新興国の株式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>運用の効率化をはかるため、新興国株式を対象とした株価指数先物取引を利用することがあります。このため、マザーファンドの受益証券の組入総額および株価指数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>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。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、新興国株式、新興国株式を対象とした株価指数先物取引、新興国株式の指数を対象指数としたETFおよび国内の債券に投資し、新興国の株式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>運用の効率化を図るため、新興国株式を対象とした株価指数先物取引を利用することがあります。このため、新興国株式および新興国株式の指数を対象指数としたETFの組入総額ならびに新興国株式を対象とした株価指数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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、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26年9月10日当初設定)
決算日	毎年6月15日(第1計算期間は、平成27年6月15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0.324%(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。
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。

30. 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вити・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ー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ーに注目します。</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	<p>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</p> <p>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</p> <p>管理事務代行会社:BNY Mellon Investment Servicing(インターナショナル)・リミテッド</p>
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	<p>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。</p>

31. 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)

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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
マザーファンドの投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
主な投資制限	<p>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。</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0.378%(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。
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、Citigroup Index LLCが開発した、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、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、Citigroup Index LLCに帰属します。

32. 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。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャー及びデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
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0.4104% (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。
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。

33. ダイワ欧州債券ファンド (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	投資成果をシティ欧州世界国債インデックス(5年超・ヘッジなし・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	欧州の債券
投資態度	主として、欧州の債券に投資し、投資成果をシティ欧州世界国債インデックス(5年超・ヘッジなし・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 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。 外貨建資産の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 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。 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。
主な投資制限	株式への投資は、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等により取得したものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資割合には、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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、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。
信託期間	無期限(平成26年9月10日当初設定)
決算日	毎年6月15日(第1計算期間は、平成27年6月15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0.3024% (税抜0.28%)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。
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	シティ欧州世界国債インデックス(5年超・ヘッジなし・円ベース)
ベンチマーク について	シティ欧州世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、欧州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。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はCitigroup Index LLCに帰属します。

34. ダイワ米国債券ファンド (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	投資成果をシティ米国債インデックス(5年超・ヘッジなし・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	米国の債券

投資態度	<p>主として、米国の債券に投資し、投資成果をシティ米国債インデックス(5年超・ヘッジなし・円ベース)の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。</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>外貨建資産の組入比率は、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>
主な投資制限	<p>株式への投資は、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等により取得したものに限り、株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、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28年3月9日当初設定)
決算日	毎年3月15日(第1計算期間は、平成29年3月15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0.29268%(税抜0.271%)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。
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	シティ米国債インデックス(5年超・ヘッジなし・円ベース)
ベンチマークについて	シティ米国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は同社に帰属します。

35. ウェリントン・グローバル総合債券(除く日本)ファンド クラスS 受益証券(円ヘッジ無、分配金有)
(ケイマン籍、円建)

(注) ウェリントン・グローバル総合債券(除く日本)ファンド クラスS 受益証券(円ヘッジ無、分配金有)(ケイマン籍、円建)は、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)(ケイマン籍、円建)が平成28年2月19日付で名称変更したものです。

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	ファンドは、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	ファンドは、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。ファンドの保有債券は、市場環境や投資機会の変化に応じ、大きく変わることがあります。

投資態度	<p>ファンドは、ベンチマーク指数に含まれる債券に投資します。</p> <p>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。ファンドの保有債券・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がありますが、経済的レバレッジは取りません。</p> <p>管理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>管理会社が適切であると認めた場合、管理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>ファンドは通常、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>ファンドは円建てとし、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、ヘッジ有り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ファンドの通貨ポジションは通常円ヘッジされます。ヘッジ有り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、各々のヘッジ有りクラス受益証券に配分されます。</p> <p>ファンドは、ファンド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>資金の借入れは、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。</p> <p>現在の運用方針は、運用基本方針の達成に最善であると投資運用会社が考える場合には変更されることがあります。ファンドの投資が顕著に変化するような運用方針の重要な変更については、受益者への事前通知が行われます。</p>
主な投資制限	<p>債券デリバティブのエクスポージャーは、ネットではファンドの100%、グロスでは200%を超えないこととします。</p> <p>同一銘柄への投資は、組み入れ時のファンド資産の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>ファンド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>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>ファンド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管理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、ファンド資産の10%以内とします。</p> <p>ファンドは投資レバレッジを目的とした借入れは行いません。</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ファンド純資産総額を超えないものとします。</p> <p>資金の借入れは、合併等による一時的な場合を除き、ファンド純資産総額の10%以下とします。</p> <p>常時換金可能ではない流動性の低い資産への投資は、ファンド純資産総額の15%以下とします。</p> <p>他の投資信託証券への投資(常時換金可能なETFを除く)は、ファンド純資産総額の5%以下とします。</p>
収益の分配	<p>管理会社の裁量により、各クラス受益証券の持分のファンド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>
信託期間	<p>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。</p>
決算日	<p>毎年12月31日</p>

管理報酬等	運用報酬0.45%(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、管理会社の裁量により予告なく変更される場合もあります。
ファンドの 関係法人	(投資運用会社)ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー (管理会社)ウエリントン・マネージメント・ファンズ・エルエルシー (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。

36. グローバル・コア債券ファンド(適格機関投資家専用)(ケイマン籍、円建)

形態	ケイマン籍信託型外国投資信託/円建て
運用の基本方針	世界の発行体が発行する主として投資適格の公社債に投資し、ベンチマーク(パークレイズ・グ ローバル総合インデックス(除く日本円))を上回る投資成果を目指します。
主要投資対象	世界の発行体が発行する公社債
投資態度	世界の発行体が発行する主として投資適格の公社債に投資し、ベンチマーク(パークレイズ・ グローバル総合インデックス(除く日本円))を上回る投資成果を目指します。 ファンドは通常、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。 ファンドの債券ポジションに関わりなく、投資対象通貨の売り・買いポジションをアクティブにとる ことがあります。 現金または現金同等資産を除き、円建ての証券は組入れません。 収益確保を目的として各種デリバティブ取引を活用します。 対象デリバティブ取引:金利スワップ、金利先渡、インフレーション・スワップ、通貨スワップ、 金利先物、債券先物、クレジット・デフォルト・スワップ、トータル・リターン・スワップ、為替フォ ワード、債券TBA、およびこれらの取引にかかわるオプション 運用の指図に関する権限をPGIMインク、およびPGIMリミテッドに委託します。
主な投資制限	国債・ソブリン債セクターの組入比率には上限を設けません。 政府機関債、地方債、および国際機関債セクターの組入比率はファンドの純資産総額の60% を上限とします。 ファンドの純資産総額に占める社債セクターの組入比率はベンチマーク対比+50%を上限とし ます。 ファンドの純資産総額に占める証券化商品セクターの組入比率はベンチマーク対比+50%を 上限とします。 投資適格未満の債券の組入比率はファンドの純資産総額の25%を上限とします。 ファンドの純資産総額に占める新興国市場債券の組入比率はベンチマーク対比+15%を上限 とします。 ファンド全体のデュレーションのベンチマーク・デュレーションからの乖離は±2.5年以内とし ます。 デリバティブ取引によるデュレーション寄与は合計でファンド全体のデュレーションの50%以内 とします。 ファンドの各通貨エクスポージャーのベンチマークからのプラス乖離の合計、マイナス乖離の 合計はそれぞれファンドの純資産総額の30%を上限とします。 単一の発行体の証券の組入比率はファンドの純資産総額の10%を上限とします。ただし国 債・ソブリン債、デリバティブ取引のカウンターパーティについては上限を設けません。 デリバティブ取引によるデュレーション寄与は合計でファンド全体のデュレーションの50%以内 とします。
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の利子・配当等と売買益(評価益を含みます。)等の全額とし ます。 分配金額は投資運用会社とトラスティーが協働し、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	信託証書の日付(2015年8月11日)から149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5月最終営業日またはトラスティーが別途定めた日

管理報酬等	<p>ファンドの純資産総額に下記の率(年率)を乗じた額 運用報酬等:</p> <ul style="list-style-type: none"> ・純資産総額最初の100億円までの部分 年0.3000% ・純資産総額100億円超200億円までの部分 年0.2800% ・純資産総額200億円超300億円までの部分 年0.2500% ・純資産総額300億円超の部分 年0.1500% <p>管理費用: 0.15%(年率)を上限とし、4万米ドル(年額)を下限とします。 その他の諸費用、ファンドにかかる事務の処理等に要する諸費用(監査費用、法律顧問への報酬、印刷費用等を含みます)は、ファンドより実費にて支払われます。また、この他有価証券売買時の売買委託手数料等取引に要する費用、ファンドの資産およびその収益に関する租税等もファンドの負担となります。</p>
ファンドの関係法人	(投資運用会社) プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社 (カストディアン) ブラウン・ブラザーズ・ハリマン & Co. (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	バークレイズ・グローバル総合インデックス(除く日本円)
ベンチマークについて	バークレイズ・グローバル総合インデックス(除く日本円)は、バークレイズ・バンク・ピーエルシーおよび関連会社(バークレイズ)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バークレイズに帰属します。

37. ブルーベイ欧州総合債券ファンド(ケイマン籍、円建)

形態	ケイマン籍信託型外国投資信託 / 円建て
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	バークレイズ・ユーロ総合債券インデックスをベンチマークに、主に欧州の投資適格債券への投資を行います。
投資態度	<p>バークレイズ・ユーロ総合債券インデックスに対して超過収益の獲得を目指します。 EU諸国で発行された投資適格債に少なくとも純資産額の2/3以上投資します。 EU以外の国で発行された投資適格債に対して純資産額の1/3まで投資可能とします。 B-/B3以上で投資適格未満の債券に対して純資産額の15%まで投資可能とします。 少なくとも純資産額の2/3以上は、欧州通貨資産とします。 為替変動リスクに関しては、外貨建て資産について円に対する為替ヘッジを原則行いません。</p>
主な投資制限	<p>株式および投資信託への投資は行いません。 日本を国籍とする発行体の発行する債券への投資は行いません。 容易に換金できない私募形式で販売された有価証券や非上場証券など非流動性資産に対する投資は純資産額の15%を超えないものとします。ただし144A証券や上場されることが表明された或いは上場予定にある証券についてはこの限りではありません。 現物債券の売り建ては行いません。</p>
収益の分配	分配無し
信託期間	2160年11月15日 但し一定の事由の場合、終了することがあります。
決算日	<p>毎年6月最終ファンド営業日 (ファンド営業日は、土日、ロンドンあるいはニューヨークの銀行休業日、そして12月24日を除く平日) ただし、第1計算期間は当初設定日～2016年6月30日</p>
管理報酬等	<p>運用報酬および費用は以下の通りとなります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・運用報酬 0.34% ・管理手数料(カストディ費用、管理・受託報酬等)0.15% <p>その他の費用として、有価証券の売買や先物取引の際に発生するブローカー手数料等、監査費用、法定費用等は実費で信託財産から支払われます。</p>
ファンドの関係法人	<p>管理会社: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン & Co 受託会社: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・トラスト・カンパニー(ケイマン)・リミテッド 運用会社: ブルーベイ・アセット・マネジメント・エルエルピー 資産保管会社: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン & Co</p>
ベンチマーク	バークレイズ・ユーロ総合債券インデックス

ベンチマークについて	<ul style="list-style-type: none"> ・パークレイズ・ユーロ総合債券インデックスはユーロ建てで発行されるまたは欧州通貨統合(EMU)に参加する16カ国の政府による旧通貨建てで発行されていた債券から構成。 ・全ての債券は投資適格級格付けであり、残存年数は少なくとも1年以上であることが必要であり、転換社債や変動利付債、永久債やワラント債、ストラクチャード商品は対象外。またドイツの準ローン証券についても売買上の制約や非上場に伴い流動性に欠けることを背景に対象外。 ・発行国についての定めはなく、ユーロ圏外の発行体であっても同インデックス組入基準を満たすようであれば組入対象。
------------	---

38. ゴールドマン・サックス・インスティテューショナル・ファンズ・ピーエルシー

- グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオ（FOFS用）

（注）ゴールドマン・サックス・インスティテューショナル・ファンズ・ピーエルシー - グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオ（FOFS用）は、ゴールドマン・サックス・インスティテューショナル・ファンズ・ピーエルシー - ゴールドマン・サックス・グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオ（FOFS用）が平成28年1月29日付で名称変更したものです。

形態/表示通貨	アイルランド籍外国投資証券/米ドル建て
運用の基本方針	収入(インカム)と資産価値増加(キャピタル・ゲイン)からなる高水準のトータル・リターンを獲得することを目的とします。
主要投資対象	主に、欧米の企業により発行された投資適格格付未滿に格付された高利回りの債券に投資します。また、固定利付債、変動利付債などの債券にも投資を行うことができます。
投資態度	主に、欧米の企業により発行された投資適格格付未滿に格付された高利回りの債券に投資します。固定利付債、変動利付債などの債券にも投資を行うことができます。外貨建資産については、原則として対円で為替ヘッジは行いません。
主な投資制限	<p>単一の発行体の証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%を超えないものとします。</p> <p>有価証券の空売りは行わないものとします。</p> <p>信託財産の純資産総額の10%を超える借入れは行わないものとします。</p> <p>一発行会社の発行する株式について、発行済総株数の50%を超えて当該発行会社の株式に投資は行いません。</p> <p>私募株式、非上場株式、流動性の乏しい証券化関連商品等流動性に欠ける資産について、純資産総額の10%を超える投資は行いません。</p>
収益の分配	原則として毎月分配を行う方針です。
信託期間	無期限(クラス設定日:平成20年2月12日)
決算日	原則として毎年12月31日
管理報酬等	<p>投資顧問会社報酬: 年率0.75%</p> <p>管理事務代行および保管報酬: 年0.15%を上限とし、年3万米ドルを下限とします。</p> <p>その他の諸費用: 管理会社報酬、登録、名義書換事務代行報酬及び受益者サービス報酬のほか、ファンドにかかる事務の処理等に要する諸費用(監査費用、法律顧問への報酬、印刷費用等を含みます。)は、ファンドより実費にて支払われます。また、その他、有価証券売買時の売買委託手数料等取引に要する費用、信託財産に関する租税等もファンドの負担となります。</p>
ファンドの関係法人	<p>管理会社: ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・グローバル・サービスズ・リミテッド</p> <p>投資顧問会社: ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・インターナショナル</p> <p>副投資顧問会社: ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・エル・ピー</p>
ベンチマーク	パークレイズ・US・コーポレート・ハイ・イールド・インデックス
ベンチマークについて	パークレイズ・US・コーポレート・ハイ・イールド・インデックスとは、米国大手証券会社であるパークレイズ社の算出する債券ベンチマークで、米ドル建てハイ・イールド債市場のパフォーマンスをあらわすものです。

（注）上記投資信託証券の純資産価格については、算出日における当該投資信託証券への資金の流入の動向を反映して、一定の調整が行われます。これは、資金の流入から受ける取引コスト等が投資信託証券に与えるインパクトを軽減することを意図していますが、算出日における資金の流入の動向が、純資産価格に影響を与えることになります。

39. 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）

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0.6372%(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。
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。

40. 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いません。

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、)の行使等により取得したものに限り、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	<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、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、分配を行なわないことがあります。</p>
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(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0.324%(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。
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。

41. エマージング・マーケット債券ファンド(適格機関投資家専用)(ケイマン籍、円建)

形態	ケイマン籍信託型外国投資信託 / 円建て
運用の基本方針	新興国の政府および政府機関等の発行するハードカレンシー建ての債券等を主要投資対象とし、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・ディバースィファイド)を上回る投資成果を目指します。

主要投資対象	新興国の政府および政府機関等の発行するハードカレンシー建ての債券等を主要投資対象とします。								
投資態度	新興国の政府および政府機関等の発行するハードカレンシー建ての債券等を主要投資対象として、利子収入の獲得と中長期的な信託財産の成長を目指します。 現金または現金同等資産を除き、円建ての証券は組入れません。 収益確保を目的として、現地通貨建ての新興国債券等へ投資する場合があります。 収益確保を目的として、各種デリバティブ取引を活用する場合があります。 運用の指図に関する権限をPGIMインク、およびPGIMリミテッドに委託します。 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、上記の運用が行なわれないことがあります。								
主な投資制限	ハードカレンシー建て新興国債券の組入比率は、ファンドの純資産総額の75%を下限とします。なお上限は設けません。 新興国国債、新興国準国債の組入比率は、ファンドの純資産総額の85%を下限とします。なお上限は設けません。 現地通貨建て新興国債券の組入比率は、ファンドの純資産総額の25%を上限とします。 ファンドの純資産総額に占める社債セクターの組入比率は、ファンドの純資産総額の15%を上限とします。 ハードカレンシー建て以外の先進国債券の組入比率は、ファンドの純資産総額の5%を上限とします。 ファンドの純資産総額に占める単一の国債(投資適格)の組入比率は、ベンチマーク対比+12%を上限とします。 ファンドの純資産総額に占める単一の国債(非投資適格)の組入比率は、ベンチマーク対比+8%を上限とします。 ファンドの純資産総額に占める単一の発行体(国債を除く)の証券(投資適格)の組入比率は、ベンチマーク対比+1%もしくはファンドの純資産総額10%を上限とします。 ファンドの純資産総額に占める単一の発行体(国債を除く)の証券(非投資適格)の組入比率は、ベンチマーク対比+0.5%もしくはファンドの純資産総額10%を上限とします。 現地通貨のエクスポージャーは純資産総額の20%を上限とします。 単一銘柄の組入比率は、ファンドの純資産総額の5%を上限とします。 レバレッジは使用しません。 発行国が日本、あるいは日本企業への投資は不可とします。								
収益の分配	分配対象額は、経費控除後の利子・配当等と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。分配金額は投資運用会社とトラスティーが協働し、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	信託証書の日付(平成28年X月X日)から149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5月最終営業日または、トラスティーが別途定めた日								
管理報酬等	運用報酬 <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th colspan="2">純資産総額 年率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>最初の100億円までの部分</td> <td>0.5200%</td> </tr> <tr> <td>100億円超200億円までの部分</td> <td>0.4700%</td> </tr> <tr> <td>200億円超の部分</td> <td>0.4000%</td> </tr> </tbody> </table> 管理費用 上限:純資産総額に対し0.15%(年率) 下限:年額4万米ドル ファンドにかかる事務の処理等に要する諸費用(カストディ費用、監査報酬、法律顧問への報酬、印刷費用等を含みます)は、ファンドより実費にて支払われます。また、この他有価証券売買時の売買委託手数料等取引に要する費用、ファンド資産およびその収益に関する租税等もファンドの負担となります。 管理費用に上限は設けておりますが、投資環境・市場によっては、変更される場合があります。	純資産総額 年率		最初の100億円までの部分	0.5200%	100億円超200億円までの部分	0.4700%	200億円超の部分	0.4000%
純資産総額 年率									
最初の100億円までの部分	0.5200%								
100億円超200億円までの部分	0.4700%								
200億円超の部分	0.4000%								
ファンドの関係法人	(投資運用会社)ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社 (再委託先)PGIMインク、PGIMリミテッド (トラスティー)ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・トラスト・カンパニー (アドミニストレーター)ブラウン・ブラザーズ・ハリマン & Co. (カストディアン)ブラウン・ブラザーズ・ハリマン & Co. (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	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・ディバースファイド								

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・ディ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一切の権利はJPモルガン社に帰属します。
------------	--

42. 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。

43. 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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>株式への直接投資は、行ないません。</p> <p>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>
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	<p>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)</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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じ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。</p>
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)の所有権及びその他一切の権利は、S&P Dow Jones Indices LLCが有しています。S&P Dow Jones Indices LLC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。

44. 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	<p>わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。</p> <p>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。</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。)の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>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。</p> <p>投資信託証券への投資は、行ないません。</p> <p>同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%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	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。

45. 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。)</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、上記のような運用が行なわれない場合があります。</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>
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	<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>管理報酬等:0.415%(管理会社代行サービス報酬を含みます。)</p> <p>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。)</p> <p>運用報酬等:0.41%</p> <p>合計:1.00%</p> <p>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。</p>
ファンドの 関係法人	<p>管理会社:ダイワ・アセット・マネジメント・サービシズ・リミテッド(ケイマン)</p> <p>受託会社:G.A.S.(ケイマン)リミテッド</p> <p>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</p> <p>資産保管会社:SMT Trustees (Ireland) Limited</p> <p>管理事務代行会社:SMT Fund Services (Ireland) Limited</p> <p>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</p>

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27年12月末現在)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。
-------------------------------------	--

46. 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)

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ことがあります。 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時、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> <ol style="list-style-type: none"> 1. 当該モデルの概略は次のとおりです。 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。 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。 ハ. 投資魅力度から個別銘柄の期待収益率を算出します。 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。 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。 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。 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時、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	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。 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	信託報酬の総額は、信託財産の純資産総額に年0.4428%(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。
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。

47. 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	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。 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。 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。 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。 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。 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。 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。

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。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(評価損益も含みます。)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0.5508%(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。
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。

48. 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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楽しみます。</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>
マザーファンドの投資態度	<p><短期金利戦略マザーファンド></p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p><イールドカーブ戦略マザーファンド></p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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（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。</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いません。</p> <p>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と売買益（評価益を含みます。）等とします。</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）
信託財産留保額	換金申込受付日の翌営業日の基準価額に0.1%の率を乗じて得た額
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率0.3672%（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。</p>
ファンドの関係法人	<p>委託会社：T & D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	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。
------------	-------------

49. 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	<p>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基づき銘柄を選定し、ポートフォリオを構築します。</p> <p>信用取引による売建てを行なうことがあります。</p> <p>先物取引による売建てを行なうことがあります。</p> <p>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。</p> <p>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。</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、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> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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>外貨建資産への投資は行ないません。</p> <p>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> <p>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。</p> <p>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。</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、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。</p>
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	<p>信託報酬の総額は、投資信託財産の純資産総額に年率1.35%(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。</p> <p>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みます。)、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。</p>
ファンドの関係法人	<p>委託会社: シンプレクス・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	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。

50. ニッセイ・グローバル・ボンド・オポチュニティ（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・グローバル・ボンド・オポチュニティ 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、公社債等に投資を行う場合があります。

投資態度	<p>主として、ニッセイ・グローバル・ボンド・オポチュニティ マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本および世界の先進国の公社債に分散投資を行うとともに、国債先物取引等のデリバティブ取引を行うことで安定的にプラスリターンを確保をめざして運用を行います。</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、為替変動リスクの低減を図ることをめざします。</p> <p>上記マザーファンドの受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。</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>主として、日本および世界の先進国の公社債に分散投資を行うとともに、国債先物取引等のデリバティブ取引を行うことで安定的にプラスリターンを確保をめざして運用を行います。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることをめざします。</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>
主な投資制限	<p>株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、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。なお、ここでいう新株予約権とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(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。)の新株予約権をいいます。</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、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。</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> <p>デリバティブ取引等の利用は、ヘッジ目的に限定しません。</p> <p>デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。</p> <p>一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ取引等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい、当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p>
収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の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。</p> <p>分配金額は、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27年3月6日当初設定)
決算日	毎年3月5日(第1計算期間は平成28年3月7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下記の率を乗じて得た額とします。</p> <p>100億円以下の部分年率0.53028%(税抜0.491%)</p> <p>100億円超200億円以下の部分年率0.50868%(税抜0.471%)</p> <p>200億円超500億円以下の部分年率0.48708%(税抜0.451%)</p> <p>500億円超の部分年率0.45468%(税抜0.421%)</p> <p>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>
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</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。

51. S M A M ・国内株式ロングショートVファンド(F0Fs用)(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	信託財産の安定的な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	国内株式ロングショートV・マザーファンド(以下、「マザーファンド」といいます。)受益証券を主要投資対象とします。

投資態度	<p>マザーファンド受益証券等への投資を通じて、実質的に次のような運用を行います。</p> <p>主としてわが国の株式への投資と、信用取引等による株式の売建てを活用した運用を行うことにより、市場リスクを限定しつつ、信託財産の安定的な成長を図ることを目標に運用を行います。</p> <p>株式の買付けおよび株価指数先物取引等の買建てによる「ロングポジション」と、信用取引等による株式の売建ておよび株価指数先物取引等の売建てによる「ショートポジション」は、概ね同額程度とし、かつ、それぞれ信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>運用に当たっては、アナリストによる個別銘柄リサーチを活用し、バリュエーションの変化を投資機会として捉えることを目指します。</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>主としてわが国の株式への投資と、信用取引等による株式の売建てを活用した運用を行うことにより、市場リスクを限定しつつ、信託財産の安定的な成長を図ることを目標に運用を行います。</p> <p>株式の買付けおよび株価指数先物取引等の買建てによる「ロングポジション」と、信用取引等による株式の売建ておよび株価指数先物取引等の売建てによる「ショートポジション」は、概ね同額程度とし、かつ、それぞれ信託財産の純資産総額の範囲内とします。</p> <p>運用に当たっては、アナリストによる個別銘柄リサーチを活用し、バリュエーションの変化を投資機会として捉えることを目指します。</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>
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>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。</p> <p>デリバティブ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、経費控除後の利子、配当等収益と売買益(評価損益を含みます。)等の範囲内とします。</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、分配対象額が少額の場合等には、委託者の判断により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	年1回(原則として2月20日。休業日の場合は翌営業日)
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1.0692%(税抜0.99%)の率を乗じて得た額とします。</p> <p>上記の他、ファンドの監査費用や有価証券の売買時の手数料、資産を外国で保管する場合の費用等(それらにかかる消費税等相当額を含みます)が信託財産から支払われます。</p>
ファンドの関係法人	<p>委託会社:三井住友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	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。

52. ニューバーガー・バーマンUSロング・ショート・エクイティ・ファンド・分配なし・円ヘッジクラス 投資証券(円建)

形態	アイルランド籍追加型投資信託/円建て
運用の基本方針	ファンドの元本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	上場及び店頭登録の株式、債券など

投資態度	<p>主として米国株式市場において上場又は取引される株式及びETFを含む株式関連商品を投資対象とし、これらの投資対象のロング及びシンセティックショートポジション(ETF、株式、株式関連商品及び株価指数等を対象とし、先物取引やオプション取引等のデリバティブ取引を用いた合成ショートポジション等を指すものとします。)を構築します。また、米国以外の世界の株式市場において上場又は取引される株式及びETFを含む株式関連商品についても投資対象とし、同様のポジションを構築する場合があります。</p> <p>投資対象とする株式及び株式関連商品は、すべてのセクターにおける原則として購入時において250百万米ドル以上の時価総額を有する企業とします。</p> <p>ファンドのネットエクスポージャー(ロングポジション及びシンセティックショートポジションの合計をいいます。)は、通常の場合において正の値をとりますが、市場環境等を勘案し原則としてファンドの純資産総額の-20~+150%の範囲をめざします。</p> <p>ロングポジションを構成する株式及び株式関連商品の銘柄の選定にあたっては、原則として副投資顧問会社により、市場において過小評価されていると判断され、かつ成長分野における競争力、長期的なキャッシュフロー創出力、独自に計測した本源的価値からの乖離及び合併等の『カタリスト』の潜在的な対象といった観点に基づき評価を行うものとします。</p> <p>副投資顧問会社は、資産又は証券の価値の減少が見込まれると判断した資産又は証券にかかるヘッジ目的又は資産の効率的な運用のため、シンセティックショートポジションを構築する場合があります。</p> <p>副投資顧問会社は、上記に加えてロングポジションの一部として、原則として米国及び米国以外の企業が発行する債券(投資適格未滿の格付け及び格付けがないものも含まれます。)にグロスエクスポージャーの30%を上限として投資を行う場合があります。なお、債券を対象とするETFを通じて、シンセティックショートポジションを構築する場合があります。債券の銘柄の選定にあたっては、原則として副投資顧問会社により、フリーキャッシュフロー創出力及び債務弁済能力等の観点から、強固な経営及び妥当なバリュエーションを有するかどうか等の評価を行うものとします。</p> <p>上記の運用を行うため、ファンドは外国市場における先物取引やオプション取引等のデリバティブ取引を利用することがあります。</p> <p>ポートフォリオ構築にあたっては、原則として北米市場を中心として特定の地域及びセクターに集中することのないものとします。また、新興国市場の発行体及び銘柄にも投資を行う場合があります。</p> <p>大量の追加設定又は解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想される時、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。</p>
主な投資制限	<p>ネットエクスポージャーは、原則としてファンドの純資産総額の-20~+150%の範囲をめざします。</p> <p>グロスエクスポージャーは、原則としてファンドの純資産総額の160%を上限とします。</p> <p>単一の企業が発行する証券への投資割合は、原則としてファンドの純資産総額の10%を超えないものとします。</p> <p>原則として、有価証券の空売りは行わないものとします。</p> <p>原則として、信託財産の純資産総額の10%を超えて借入は行わないものとします。</p>
収益の分配	無し
信託期間	無期限(平成26年4月23日当初設定)
決算日	12月31日
管理報酬等	<p>運用報酬等:年率1.35% 管理報酬等:年率0.20%(上限)。但し年間75,000米ドルを最低報酬額とします。</p> <p>上記の他、信託財産にかかる租税、組入有価証券の売買時にかかる費用、信託事務の処理に要する費用、信託財産の監査にかかる費用、ファンドの設立にかかる費用、現地での登録料、法律顧問費用、名義書換事務代行費用、管理費用、組入有価証券の保管に関する費用、借入金や立替金に関する利息、ファンドの運用報告書等の印刷及び配布等に関する費用等はファンドの信託財産から負担されます。</p> <p>上記の報酬等は将来変更される場合があります。なお、これらの報酬・費用等については、取引内容等により金額が決定し、その発生若しくは請求の都度費用として認識されるため、又は運用状況等により変動するため、その上限額及び計算方法を記載することができません。</p>
ファンドの 関係法人	<p>投資運用会社:ニューバーガー・バーマン・ヨーロッパ・リミテッド 副投資顧問会社:ニューバーガー・バーマン・インベストメント・アドバイザーズ・エルエルシー 管理事務代行会社: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・ファンド・アドミニストレーション・サービシーズ(アイルランド)・リミテッド 保管会社: ブラウン・ブラザーズ・ハリマン・トラスティ・サービシーズ(アイルランド)・リミテッド</p>
ベンチマーク	該当なし

ベンチマーク について	該当なし
----------------	------

【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

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。

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وران・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(旧WMC)
2015年	1月1日付でウエリントン・マネージメント・グループ・エルエルピーに社名変更し、持株会社事業に特化 新たにデラウェア州籍の事業運営会社ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー(新WMC)を設立し、旧WMCより投資運用業務を継承

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19日	第一投信株式会社設立
	同年12月26日「証券投資信託法」（当時）に基づく免許取得
平成 9年12月 1日	社名を長期信用投信株式会社に変更
平成11年 2月25日	大同生命保険相互会社（現：大同生命保険株式会社）の傘下に入る
平成11年 4月 1日	社名を大同ライフ投信株式会社に変更

平成14年 1月24日投資顧問業者の登録

平成14年 6月11日投資一任契約に係る業務の認可

平成14年 7月 1日ティ・アンド・ディ太陽大同投資顧問株式会社と合併、

ティ・アンド・ディ・アセットマネジメント株式会社に社名を変更

平成18年 8月28日社名をT & Dアセットマネジメント株式会社に変更

平成19年 3月30日株式会社T & Dホールディングスの直接子会社となる

平成19年 9月30日金融商品取引法の施行に伴い、第二種金融商品取引業、

投資助言・代理業、投資運用業の登録

ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社

平成8年2月6日	会社設立
平成14年4月1日	ゴールドマン・サックス・アセット・マネージメント・ジャパン・リミテッドの営業の全部を譲受け、商号をゴールドマン・サックス投信株式会社からゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント株式会社に変更

ニューバーガー・バーマン・ヨーロッパ・リミテッド

2005年5月 ニューバーガー・バーマン・ヨーロッパ・リミテッド設立

2006年3月 投資顧問業（助言）登録（英国）

2006年4月 投資運用業（一任）登録（英国）

D I A Mアセットマネジメント株式会社

昭和60年7月1日 会社設立

平成10年3月31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

平成10年12月1日 証券投資信託法の改正に伴う証券投資信託委託業のみなし認可

平成11年10月1日 第一ライフ投信投資顧問株式会社を存続会社として興銀エヌダブリュ・アセットマネジメント株式会社および日本興業投信株式会社と合併し、社名を興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社とする。

平成20年1月1日 「興銀第一ライフ・アセットマネジメント株式会社」から「D I A Mアセットマネジメント株式会社」に商号変更

S B Iアセットマネジメント株式会社

昭和61年 8月29日 日債銀投資顧問株式会社として設立

昭和62年 2月20日 有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律第4条にかかる登録

昭和62年 9月9日 有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律第24条1項の規定に基づく投資一任契約業務の認可

平成12年11月28日 証券投資信託及び証券投資法人に関する法律第6条の規定に基づく証券投資信託委託業の認可

平成13年1月4日 あおぞらアセットマネジメント株式会社に商号変更

平成14年5月1日 ソフトバンク・アセット・マネジメント株式会社との合併により、エスピーアイ・アセット・マネジメント株式会社に商号変更

平成17年7月1日 SBIアセットマネジメント株式会社に商号変更

平成19年9月30日 金融商品取引法等の施行により同法第29条の規定に基づく金融商品取引業者の登録（関東財務局長（金商）第311号）

明治安田アセットマネジメント株式会社

昭和61年11月	コスモ投信株式会社設立
平成10年10月	ディーアンドシーキャピタルマネージメント株式会社と合併、商号を「コスモ投信投資顧問株式会社」に変更
平成12年 2月	商号を「明治ドレスナー投信株式会社」に変更
平成12年 7月	明治ドレスナー・アセットマネジメント株式会社と合併、商号を「明治ドレスナー・アセットマネジメント株式会社」に変更
平成21年 4月	商号を「MDAMアセットマネジメント株式会社」に変更
平成22年10月	安田投信投資顧問株式会社と合併、商号を「明治安田アセットマネジメント株式会社」に変更

損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社

昭和61年 2月25日	安田火災投資顧問株式会社設立
昭和62年 2月20日	投資顧問業の登録
昭和62年 9月9日	投資一任業務の認可取得
平成3年 6月1日	プリンソン・パートナーズ投資顧問株式会社と合併し、安田火災プリンソン投資顧問株式会社に商号変更
平成10年 1月1日	安田火災グローバル・アセット・マネジメント株式会社に商号変更
平成10年 3月3日	安田火災グローバル投信投資顧問株式会社に商号変更
平成10年 3月31日	証券投資信託委託業の免許取得
平成14年 7月1日	損保ジャパン・アセットマネジメント株式会社に商号変更
平成19年 9月30日	金融商品取引業者として登録
平成22年 10月1日	ゼスト・アセットマネジメント株式会社と合併し、損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント株式会社に商号変更

新光投信株式会社

昭和36年6月	大井証券投資信託委託株式会社設立・免許取得
昭和44年10月	新和光投信委託株式会社に社名変更
昭和61年11月	有価証券等に関する投資助言・情報提供業務の認可
平成8年8月	投資顧問業者の登録
平成8年12月	投資一任契約にかかる業務の認可
平成9年11月	投資信託の直接販売業務の認可
平成10年12月	証券投資信託法の改正に伴う投資信託の証券投資信託委託業のみなし認可
平成12年4月	太陽投信委託株式会社と合併し、新光投信株式会社に社名変更

ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社

1988年12月	(PAMJ) ブルデンシャル投資顧問株式会社設立
1998年9月	(PIJ) ブルデンシャル三井トラスト投信株式会社設立

2000年4月	(PAMJ) プルデンシャル・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社へ商号変更
2000年4月	(PIJ) プルデンシャル投信株式会社へ商号変更
2001年11月	(PIMJ Inc) 米国デラウェア州にプルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン・インク設立
2002年2月	(PIMJ Inc) 関東財務局に投資顧問業者として登録される
2002年11月	(PIMJ Inc) 投資一任業務の認可及び、投資信託委託業の認可を受ける
2002年12月	(PIMJ Inc) プルデンシャル投信株式会社とプルデンシャル・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社よりそれぞれの営業の全部譲渡を受け、投資信託委託業および投資顧問業の営業を開始
2006年4月	(PIMJ) プルデンシャル投信投資顧問準備株式会社設立
2006年6月	(PIMJ) 関東財務局に投資顧問業者として登録される
2006年8月	(PIMJ) 投資一任業務の認可及び投資信託委託業の認可を受ける
2006年8月	(PIMJ) プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社へ商号変更
2006年9月	(PIMJ) プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン・インクから事業の全部譲渡を受け、投資信託委託業および投資顧問業の営業を開始
2007年9月	(PIMJ) 関東財務局に金融商品取引業者として登録される

上記の会社沿革表には当社（プルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン株式会社、PIMJ）の前身であるプルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン・インク（PIMJ Inc）、およびその前身であるプルデンシャル・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社（PAMJ）、プルデンシャル投信株式会社（PIJ）についても記載しております。混乱を避けるため、事項の先頭に（PIMJ）／（PIMJ Inc）／（PAMJ）／（PIJ）と記載して、区別をしております。

BNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社

平成10年11月 6日	ドレイファス・メロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社設立
平成10年11月30日	投資顧問業者の登録 関東財務局長 第828号
平成11年12月 9日	投資一任契約にかかる業務の認可取得 金融再生委員会第21号
平成12年 1月 1日	会社名をメロン・アセットマネジメント・ジャパン株式会社に変更
平成12年 5月18日	証券投資信託委託業の認可取得 金融再生委員会第28号
平成13年10月 1日	会社名をメロン・グローバル・インベストメンツ・ジャパン株式会社に変更
平成19年 9月30日	金融商品取引法の規定に基づく登録 金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第406号
平成19年11月 1日	会社名をBNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社に変更

ブルーベイ・アセット・マネジメント・エルエルピー

2001年 7月	英国にて会社設立
2006年11月	ブルーベイ・アセット・マネジメント・ピーエルシー、ロンドン証券取引所上場
2010年12月	ブルーベイ・アセット・マネジメント・ピーエルシーがロイヤル・バンク・オブ・カナダの100%子会社となり、上場廃止
2011年 1月	ブルーベイ・アセット・マネジメント・ピーエルシーをブルーベイ・アセット・マネジメント・リミテッドに社名変更
2012年 4月	ブルーベイ・アセット・マネジメント・リミテッドをブルーベイ・アセット・マネジメント・サービシーズ・リミテッドに社名変更、同時に新たにブルーベイ・アセット・マネジメント・エルエルピーを設立し、投資運用事業を含む全てのビジネスを同社に移管

三井住友アセットマネジメント株式会社

昭和60年7月15日 三生投資顧問株式会社設立
 昭和62年2月20日 証券投資顧問業の登録
 昭和62年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可
 平成11年1月1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合
 平成11年2月5日 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更
 平成12年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得
 平成14年12月1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更
 平成25年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

NNインベストメント・パートナーズ株式会社

平成11年9月8日 アイエヌジー投信株式会社設立
 平成11年9月30日 証券投資信託委託業の認可取得（金融再生委員会第16号）投資顧問業の登録（関東財務局長 第884号）
 平成12年11月30日 投資信託及び投資法人に関する法律の平成12年法97附則第9条に基づく投資信託委託業のみ
 なし認可
 平成17年8月31日 投資一任契約に係る業務の認可取得（内閣総理大臣第56号）
 平成19年9月30日 金融商品取引業のみなし登録（関東財務局長（金商）第300号）
 平成21年1月5日 第一種金融商品取引業の業務開始
 平成27年4月7日 商号を「NNインベストメント・パートナーズ株式会社」に変更

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

< 訂正前 >

< 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 >

外国証券への投資に伴うリスク

（ FW外国株式EM+の と同内容 ）

< 略 >

< 訂正後 >

< 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 >

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入実質外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。特に、新興国の為替レートは短期間に大幅に変動することがあり、先進国と比較して、相対的に高い為替変動リスクがあります。

当ファンドにおいて、保有実質外貨建資産については、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。そのため基準価額は、為替レートの変動の影響を直接受けま
す。

なお、投資する指定投資信託証券において為替ヘッジを行なう場合、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、日本円の金利が組入外貨建資産の通貨の金利より低いときには、金利差相当分がコストとなります。

ロ．カントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。

新興国においては、欧米等の先進国と比較して、非常事態など（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争など）の発生や、証券の決済の遅延・不能等の発生の可能性が高く、より大きなカントリー・リスクが伴い、ファンドの基準価額に悪影響が生じる可能性があります。

< 略 >

末尾の「参考情報」を次の内容に訂正・更新します。

参考情報

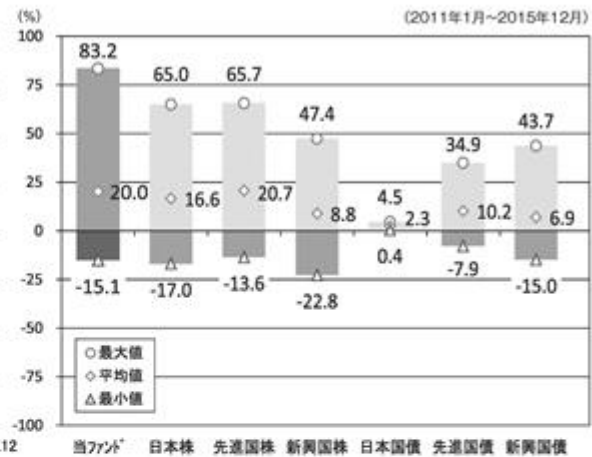
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

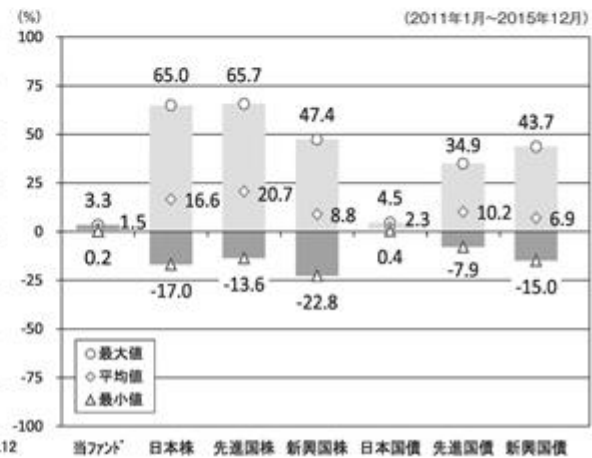
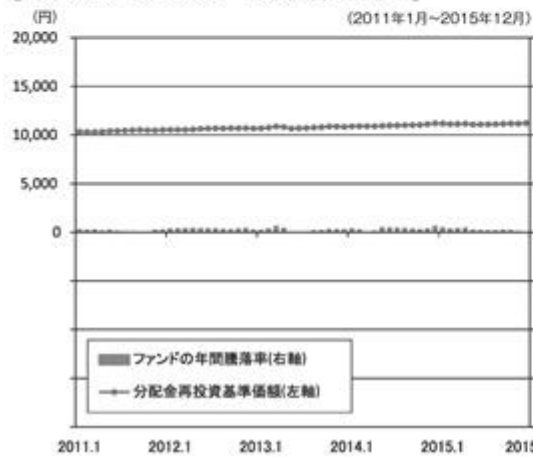
[ダイワファンドラップ 日本株式セレクト]



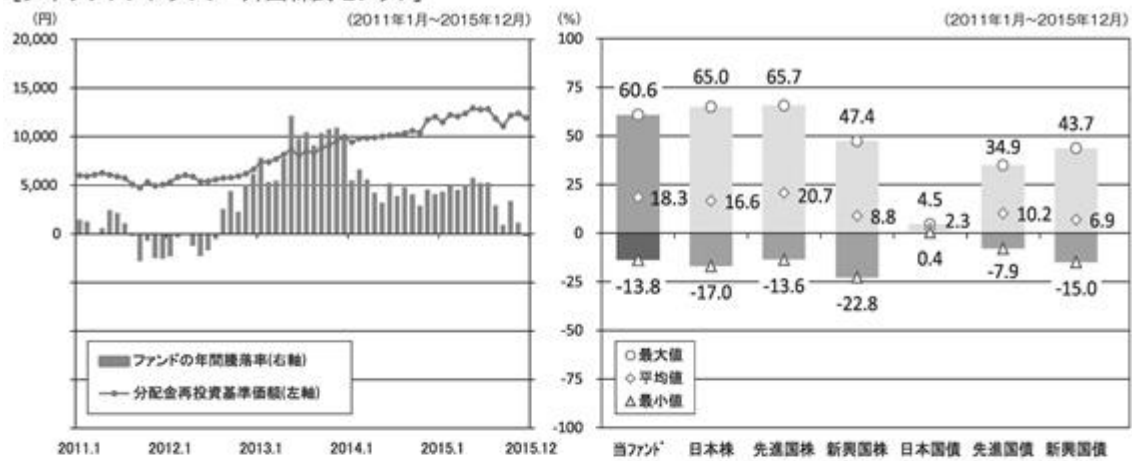
他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



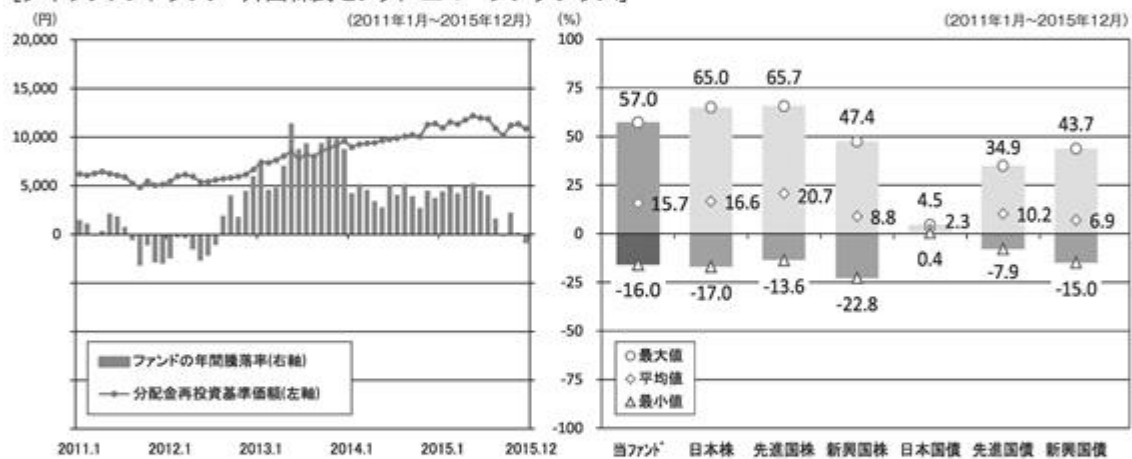
[ダイワファンドラップ 日本債券セレクト]



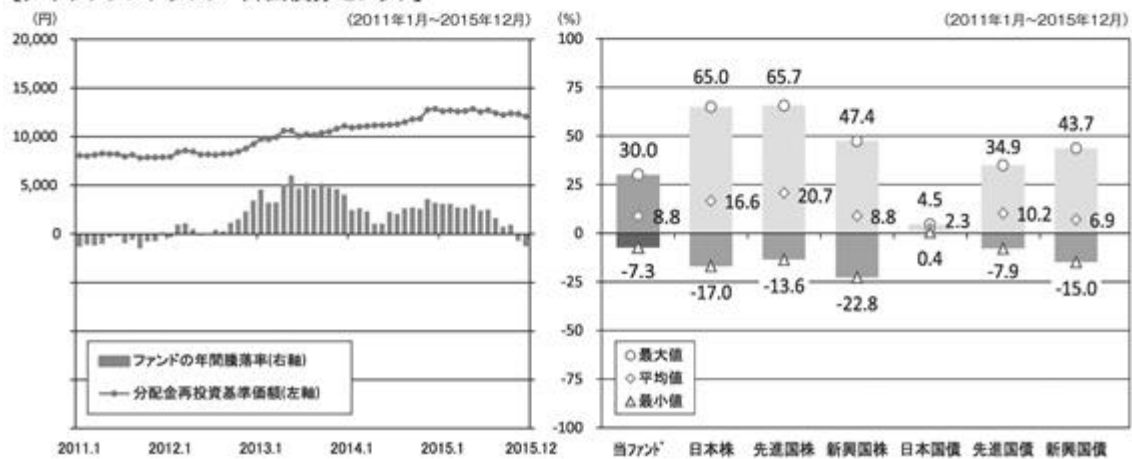
[ダイワファンドラップ 外国株式セレクト]



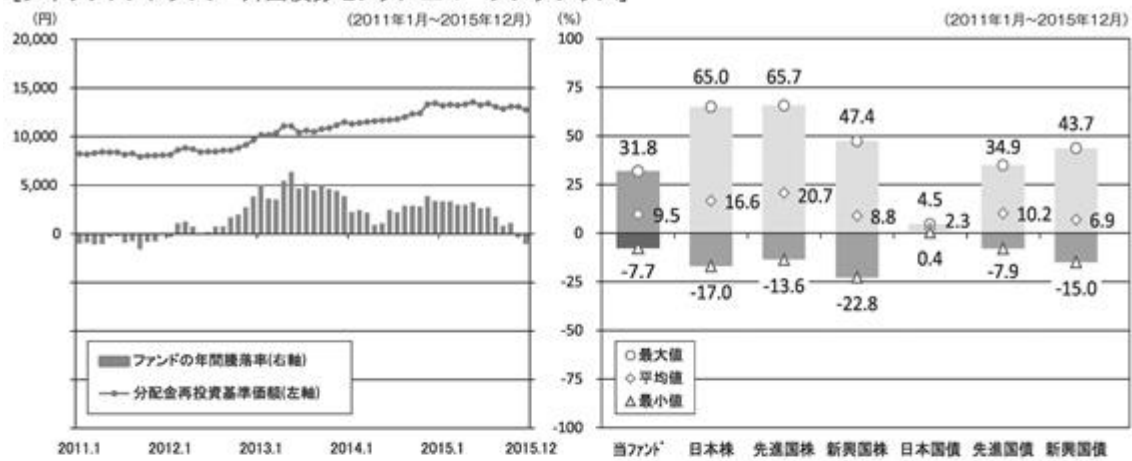
[ダイワファンドラップ 外国株式セレクト エマージングプラス]



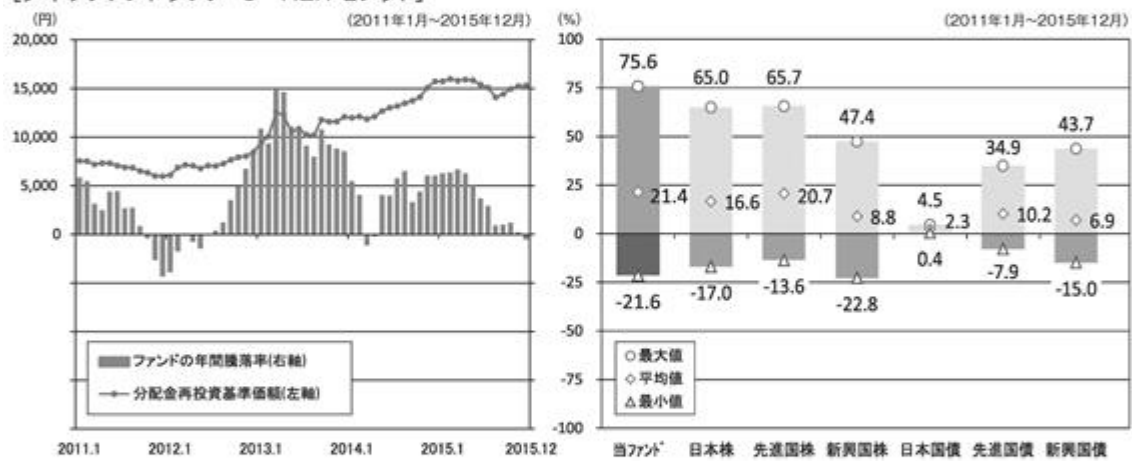
[ダイワファンドラップ 外国債券セレクト]



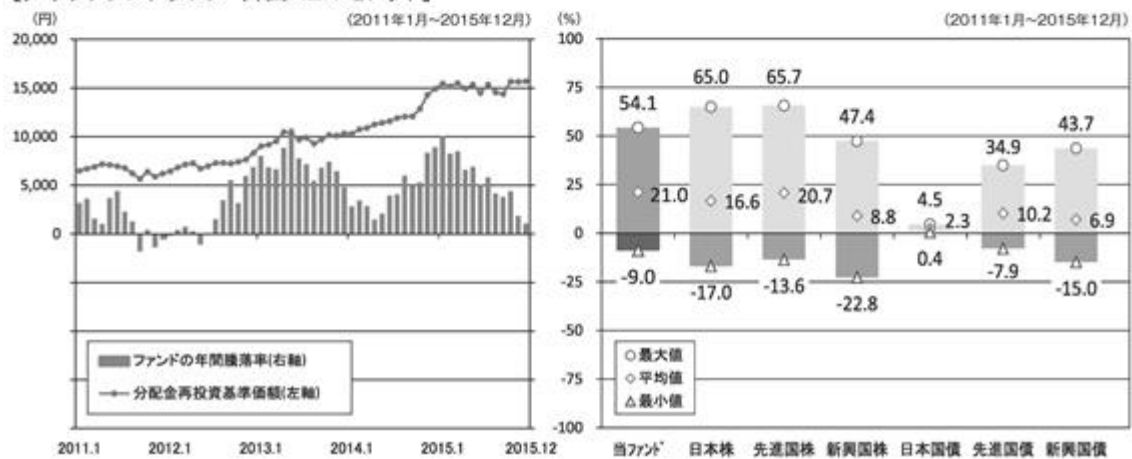
[ダイワファンドラップ 外国債券セレクト エマージングプラス]



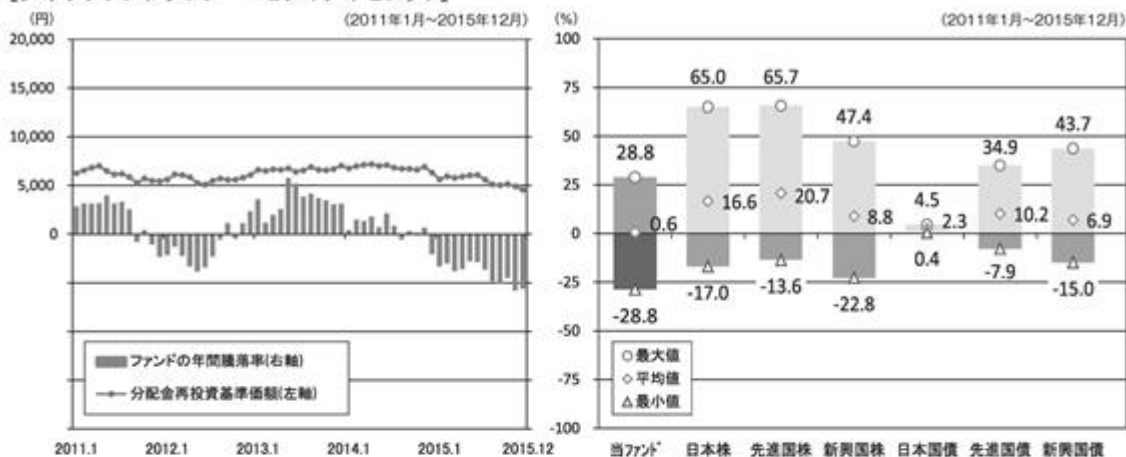
[ダイワファンドラップ J-REITセレクト]



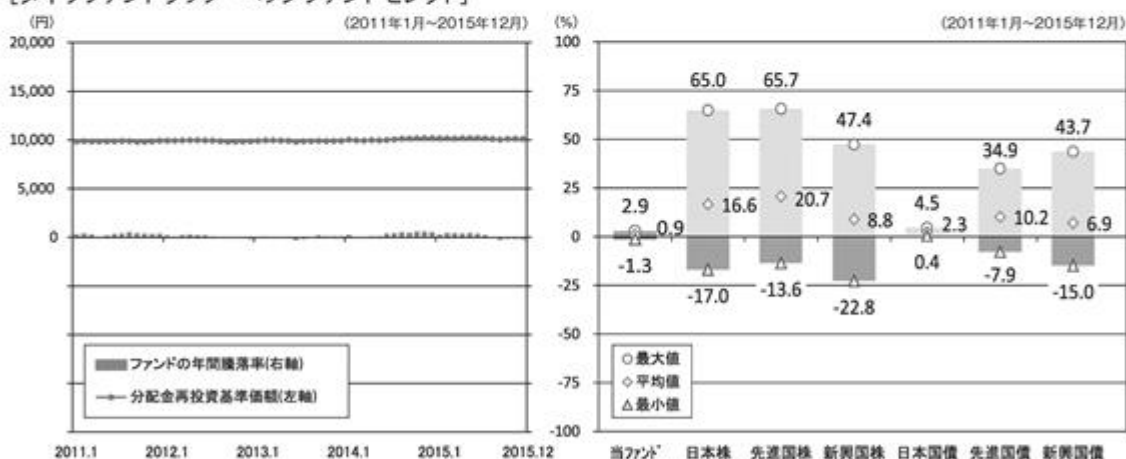
[ダイワファンドラップ 外国REITセレクト]



[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]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

※資産クラスについて

日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)
 先進国株：MSCIコクサイ・インデックス (配当込み、円ベース)
 新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)
 日本国債：NOMURA-BPI国債
 先進国債：シティ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド (円ベース)

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村証券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(3) 【信託報酬等】

< 訂正前 >

< 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27年8月時点）	
FW日本株式セレクト	1.018 ± 0.29%程度
FW日本債券セレクト	新発10年固定利付国債利回りが 1%未満の場合 0.521 ± 0.09%程度 1%以上2%未満の場合 0.528 ± 0.10%程度
FW外国株式セレクト	1.382 ± 0.30%程度
FW外国株式EM+	1.383 ± 0.36%程度
FW外国債券セレクト	1.034 ± 0.22%程度
FW外国債券EM+	1.002 ± 0.19%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	1.222 ± 0.33%程度

< 略 >

< 訂正後 >

< 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28年2月時点）	
FW日本株式セレクト	1.032 ± 0.31%程度
FW日本債券セレクト	新発10年固定利付国債利回りが 1%未満の場合 0.462 ± 0.08%程度 1%以上2%未満の場合 0.498 ± 0.07%程度
FW外国株式セレクト	1.289 ± 0.50%程度
FW外国株式EM+	1.289 ± 0.50%程度
FW外国債券セレクト	0.931 ± 0.16%程度
FW外国債券EM+	0.937 ± 0.16%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	1.081 ± 0.19%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

< 略 >

八．損益通算について

一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、上場株式等の譲渡益と相殺することができ、申告分離課税を選択した上場株式等の配当所得との損益通算も可能となります。また、一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等の譲渡損との相殺が可能となります。

平成28年1月1日以降、上記の損益通算の対象範囲に、特定公社債等（公募公社債投資信託を含みます。）の利子所得および譲渡所得等が追加されます。

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

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。

なお、益金不算入制度（「FW日本株式セレクト」のみ。対象金額は四分の一となります。）および税額控除制度が適用されます。ただし、平成27年4月1日以降に開始する事業年度については、益金不算入制度の適用はありません。

< 略 >

（ ）上記は、平成27年6月末現在のもので、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

< 略 >

八．損益通算について

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

なお、特定口座にかかる課税上の取扱いにつきましては、販売会社にお問合わせ下さい。

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。なお、益金不算入制度（「FW日本株式セレクト」のみ。対象金額は四分の一となります。）が適用されます。ただし、平成27年4月1日以降に開始する事業年度については、益金不算入制度の適用はありません。

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

< 略 >

() 上記は、平成28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27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	250,540,303,419	99.32
内 日本	250,540,303,419	99.32
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,727,784,056	0.68
純資産総額	252,268,087,475	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27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・バリュー株・オープン	日本	投資信託 受益証券	46,864,400,050	1.1188 52,432,908,724	1.0646 49,891,840,293	19.78
2	ダイワ・スマート日本株ファンダメンタル・ファンド	日本	投資信託 受益証券	46,049,953,486	1.1002 50,667,231,176	1.0277 47,325,537,197	18.76
3	SBI/アリアンツ日本株集中投資戦略ファンド	日本	投資信託 受益証券	36,810,557,920	1.0426 38,381,000,000	1.0869 40,009,395,403	15.86
4	DIAM国内株式アクティブ市場型ファンド	日本	投資信託 受益証券	30,341,408,284	1.0238 31,066,000,000	1.0728 32,550,262,807	12.90
5	J Flag 中小型株ファンド	日本	投資信託 受益証券	5,834,472,959	3.1955 18,644,094,351	3.5093 20,474,915,955	8.12
6	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	13,037,943,522	1.5294 19,940,937,063	1.5376 20,047,141,959	7.95
7	大和住銀ニッポン中小型株ファンド	日本	投資信託 受益証券	11,760,796,782	1.0977 12,910,731,111	1.0678 12,558,178,803	4.98
8	GIM日本株・ファンド	日本	投資信託 受益証券	11,500,364,281	1.1635 13,381,729,083	1.0890 12,523,896,702	4.96
9	T&D/マイルストーン日本株ファンド	日本	投資信託 受益証券	6,635,633,649	1.1554 7,667,185,158	1.1503 7,632,969,386	3.03
10	ダイワ好配当日本株投信Q	日本	投資信託 受益証券	6,340,492,767	1.2725 8,068,548,806	1.1870 7,526,164,914	2.98

(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	99.32%
合計	99.32%

(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】

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
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
第7計算期間末 (平成26年6月16日)	82,881,363,755	82,881,363,755	1.0512	1.0512
平成26年12月末日	139,393,651,210	-	1.2141	-
平成27年1月末日	148,533,945,838	-	1.1988	-
2月末日	165,995,888,067	-	1.2594	-
3月末日	180,750,087,087	-	1.2797	-
4月末日	196,685,904,126	-	1.3320	-
5月末日	211,631,910,983	-	1.3749	-
第8計算期間末 (平成27年6月15日)	216,782,737,060	216,782,737,060	1.3695	1.3695
6月末日	219,037,392,791	-	1.3512	-
7月末日	227,232,374,331	-	1.3693	-
8月末日	223,944,742,880	-	1.2951	-
9月末日	208,652,548,520	-	1.1751	-
10月末日	237,448,081,038	-	1.2947	-

11月末日	253,448,396,700	-	1.3422	-
12月末日	252,268,087,475	-	1.3141	-

【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
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
平成27年6月16日～ 平成27年12月15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
第7計算期間	21.2
第8計算期間	30.3
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	5.1

(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
第7計算期間	51,226,468,647	15,794,813,930
第8計算期間	109,304,273,794	29,847,991,034
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	49,817,103,933	18,933,125,664

(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27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	424,458,670,877	99.30
内 日本	424,458,670,877	99.30
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,995,845,930	0.70
純資産総額	427,454,516,807	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27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	マニユライフ日本債券アクティブ・ファンドM	日本	投資信託 受益証券	125,294,437,131	1.0972 137,484,134,295	1.1178 140,054,121,825	32.76
2	明治安田日本債券アクティブ・ファンド	日本	投資信託 受益証券	112,876,671,037	1.0079 113,777,000,000	1.0154 114,614,971,770	26.81
3	ダイワ・ダイナミック日本債券ファンド	日本	投資信託 受益証券	62,045,572,796	1.0062 62,434,744,858	1.0260 63,658,757,688	14.89
4	国内債券スイッチング戦略ファンド	日本	投資信託 受益証券	50,375,099,981	1.0037 50,564,000,000	1.0113 50,944,338,610	11.92
5	損保ジャパン日本興亜RMBSファンド	日本	投資信託 受益証券	21,032,467,893	1.0013 21,060,000,000	1.0098 21,238,586,078	4.97
6	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	19,661,480,469	1.0673 20,985,478,154	1.0797 21,228,500,462	4.97
7	東京海上日本債ファンドM	日本	投資信託 受益証券	11,718,623,958	1.0701 12,540,136,213	1.0854 12,719,394,444	2.98

(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
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
第7計算期間末 (平成26年6月16日)	126,028,972,910	126,028,972,910	1.0935	1.0935
平成26年12月末日	236,617,548,798	-	1.1199	-
平成27年1月末日	258,033,248,885	-	1.1176	-
2月末日	278,019,982,746	-	1.1122	-
3月末日	304,910,622,256	-	1.1134	-
4月末日	325,313,131,518	-	1.1171	-
5月末日	341,596,957,011	-	1.1081	-
第8計算期間末 (平成27年6月15日)	355,145,136,992	355,145,136,992	1.1039	1.1039
6月末日	368,181,245,141	-	1.1093	-
7月末日	381,710,004,915	-	1.1104	-
8月末日	400,674,372,061	-	1.1121	-
9月末日	410,867,365,981	-	1.1157	-
10月末日	408,791,620,500	-	1.1179	-
11月末日	416,517,178,633	-	1.1169	-
12月末日	427,454,516,807	-	1.1231	-

【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
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
平成27年6月16日～ 平成27年12月15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
第7計算期間	2.2
第8計算期間	1.0
平成27年6月16日～ 平成27年12月15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
第7計算期間	76,085,876,646	13,093,393,891
第8計算期間	235,023,394,951	28,540,815,991
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	98,558,256,610	43,027,721,102

(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27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	157,217,690,709	98.97
内 日本	157,217,690,709	98.97
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,628,414,626	1.03
純資産総額	158,846,105,335	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27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/ウエリントン・グローバル・オポ チュニティーズ・ファンド	日本	投資信託 受益証券	39,226,169,101	1.2741 49,980,310,741	1.1981 46,996,873,199	29.59
2	MFS外国株コア・ファンド	日本	投資信託 受益証券	14,932,855,836	2.2711 33,914,734,801	2.1028 31,400,809,251	19.77
3	ニッセイ/アリアンツ・欧州グロース株 式ファンド	日本	投資信託 受益証券	24,913,655,273	1.1858 29,544,292,093	1.1511 28,678,108,584	18.05
4	ダイワ・スマート米国株モメンタム・ファ ンド	日本	投資信託 受益証券	22,985,931,020	1.0235 23,527,849,631	1.0191 23,424,962,302	14.75
5	LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・ グロース・ファンド	日本	投資信託 受益証券	20,143,090,440	1.0311 20,769,726,986	1.0108 20,360,635,816	12.82
6	T.R.P欧州株式オープン	日本	投資信託 受益証券	2,946,299,560	1.1737 3,458,150,510	1.0805 3,183,476,674	2.00
7	ニッセイ/ポストン・カンパニー・米国株 ファンド	日本	投資信託 受益証券	2,728,607,571	1.2888 3,516,640,091	1.1628 3,172,824,883	2.00

(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	98.97%
合計	98.97%

(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

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
第7計算期間末 (平成26年6月16日)	44,506,996,705	44,506,996,705	1.0148	1.0148
平成26年12月末日	89,432,865,028	-	1.2040	-
平成27年1月末日	92,275,194,259	-	1.1491	-
2月末日	105,120,970,078	-	1.2228	-
3月末日	110,680,022,498	-	1.2074	-
4月末日	120,003,927,757	-	1.2381	-
5月末日	132,279,124,438	-	1.2923	-
第8計算期間末 (平成27年6月15日)	135,109,124,077	135,109,124,077	1.2832	1.2832
6月末日	137,388,464,321	-	1.2772	-
7月末日	142,011,021,112	-	1.2834	-
8月末日	136,436,250,725	-	1.1857	-
9月末日	132,088,849,722	-	1.1076	-
10月末日	156,196,941,087	-	1.2175	-
11月末日	164,590,869,138	-	1.2383	-
12月末日	158,846,105,335	-	1.1924	-

【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
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
平成27年6月16日～ 平成27年12月15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
第7計算期間	26.6
第8計算期間	26.4
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	8.6

(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
第7計算期間	31,398,791,062	8,395,932,893
第8計算期間	76,735,927,224	15,301,877,726
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	41,991,842,590	14,005,135,882

(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27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	108,913,977,633	87.12
内 日本	108,913,977,633	87.12
投資証券	14,876,262,061	11.90
内 アイルランド	14,876,262,061	11.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,224,549,129	0.98
純資産総額	125,014,788,823	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27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/ウエリントン・グローバル・オポ チュニティーズ・ファンド	日本	投資信託 受益証券	24,678,562,690	1.2802 31,595,210,960	1.1981 29,567,385,958	23.65
2	MFS外国株コア・ファンド	日本	投資信託 受益証券	9,381,215,394	2.2855 21,441,309,237	2.1028 19,726,819,730	15.78
3	ニッセイ/アリアンツ・欧州グロース株 式ファンド	日本	投資信託 受益証券	15,670,100,522	1.1902 18,651,659,166	1.1511 18,037,852,710	14.43
4	LAZARD GL ACTIVE-EM MK EQ	アイルラン ド	投資証券	1,361,374.19	13,076.77 17,802,485,532	10,927.38 14,876,262,061	11.90
5	ダイワ・スマート米国株モメンタム・ファン ド	日本	投資信託 受益証券	14,504,998,339	1.0239 14,852,291,381	1.0191 14,782,043,807	11.82
6	LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・ グロース・ファンド	日本	投資信託 受益証券	12,668,989,885	1.0310 13,062,828,113	1.0108 12,805,814,975	10.24

7	ダイワ新興国株式ファンド	日本	投資信託 受益証券	11,818,053,824	1.0169 12,018,118,807	0.8484 10,026,436,864	8.02
8	ニッセイノボストン・カンパニー・米国株 ファンド	日本	投資信託 受益証券	1,706,634,248	1.3000 2,218,736,462	1.1628 1,984,474,303	1.59
9	T.R.P欧州株式オープン	日本	投資信託 受益証券	1,835,399,617	1.1837 2,172,571,265	1.0805 1,983,149,286	1.59

(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	87.12%
投資証券	11.90%
合計	99.02%

(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
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
第7計算期間末 (平成26年6月16日)	53,314,699,393	53,314,699,393	0.9798	0.9798
平成26年12月末日	85,556,564,365	-	1.1388	-
平成27年1月末日	87,245,077,314	-	1.0952	-
2月末日	96,649,205,477	-	1.1543	-
3月末日	101,692,668,250	-	1.1339	-

4月末日	109,870,135,947	-	1.1773	-
5月末日	117,968,205,401	-	1.2184	-
第8計算期間末 (平成27年6月15日)	119,867,627,008	119,867,627,008	1.2031	1.2031
6月末日	121,655,977,343	-	1.1967	-
7月末日	123,717,669,426	-	1.1881	-
8月末日	117,006,681,683	-	1.0891	-
9月末日	112,019,535,671	-	1.0164	-
10月末日	124,858,883,105	-	1.1198	-
11月末日	129,168,302,471	-	1.1352	-
12月末日	125,014,788,823	-	1.0874	-

【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
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
平成27年6月16日～ 平成27年12月15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
第7計算期間	26.1
第8計算期間	22.8
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	11.3

(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	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
第7計算期間	24,964,482,363	12,525,223,185

第8計算期間	58,793,675,508	13,576,031,849
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	24,809,299,760	10,990,882,734

(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27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	75,847,313,319	74.26
内 日本	41,786,699,082	40.91
内 ケイマン諸島	34,060,614,237	33.35
投資証券	25,164,773,202	24.64
内 アイルランド	25,164,773,202	24.64
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,129,735,376	1.11
純資産総額	102,141,821,897	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27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	GS GLOBAL HIGH YLD PORT2	アイルランド	投資証券	2,400,297.12	11,628.25 27,911,452,846	10,484.02 25,164,773,202	24.64
2	ダイワ欧州債券ファンド	日本	投資信託 受益証券	21,486,323,811	1.0616 22,811,966,710	1.0444 22,440,316,588	21.97
3	GLOBAL CORE BOND FUND EX-JAPAN	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	2,028,893.7	10,035.02 20,360,000,000	9,877.00 20,039,383,075	19.62
4	ベアリング外国債券ファンドM	日本	投資信託 受益証券	15,525,640,326	1.0155 15,767,281,659	0.9831 15,263,257,004	14.94
5	WELLINGTON MGMT GLOBAL AGGREGATE NON YEN BOND PORT CLASS B	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	1,447,726.5	9,984.47 14,454,786,109	9,685.00 14,021,231,162	13.73
6	LM・ブランディワイン外国債券ファンド	日本	投資信託 受益証券	3,690,794,080	1.1842 4,370,707,565	1.1063 4,083,125,490	4.00

(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	74.26%
投資証券	24.64%
合計	98.89%

(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】

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
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
第7計算期間末 (平成26年6月16日)	30,866,965,780	31,145,751,529	1.1072	1.1172
平成26年12月末日	58,241,413,754	-	1.2748	-
平成27年1月末日	61,730,953,952	-	1.2508	-
2月末日	66,700,008,436	-	1.2593	-
3月末日	71,520,812,950	-	1.2478	-
4月末日	76,525,842,902	-	1.2526	-
5月末日	82,399,664,918	-	1.2730	-
第8計算期間末 (平成27年6月15日)	84,902,370,718	84,902,370,718	1.2609	1.2609
6月末日	85,979,240,255	-	1.2438	-
7月末日	91,209,318,060	-	1.2601	-
8月末日	93,488,339,029	-	1.2314	-
9月末日	94,916,539,026	-	1.2123	-
10月末日	99,580,626,761	-	1.2278	-
11月末日	101,735,884,604	-	1.2220	-
12月末日	102,141,821,897	-	1.1962	-

【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
第7計算期間	0.0100
第8計算期間	0.0000
平成27年6月16日～ 平成27年12月15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
第7計算期間	11.2
第8計算期間	13.9
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	4.2

(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
第7計算期間	18,844,583,682	3,990,533,226
第8計算期間	46,776,266,552	7,321,624,581
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	23,777,422,338	6,711,606,384

(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27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	40,707,707,812	79.27

	内 日本	26,913,668,222	52.41
	内 ケイマン諸島	13,794,039,590	26.86
投資証券		10,141,665,806	19.75
	内 アイルランド	10,141,665,806	19.75
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		502,267,467	0.98
純資産総額		51,351,641,085	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27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	GS GLOBAL HIGH YLD PORT2	アイルランド	投資証券	967,344.75	11,679.51 11,298,149,888	10,484.02 10,141,665,806	19.75
2	ダイワ欧州債券ファンド	日本	投資信託 受益証券	8,640,872,390	1.0618 9,174,981,731	1.0444 9,024,527,124	17.57
3	GLOBAL CORE BOND FUND EX-JAPAN	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	820,209.64	10,034.02 8,230,000,000	9,877.00 8,101,210,614	15.78
4	ベアリング外国債券ファンドM	日本	投資信託 受益証券	6,278,990,259	1.0160 6,379,749,541	0.9831 6,172,875,323	12.02
5	WELLINGTON MGMT GLOBAL AGGREGATE NON YEN BOND PORT CLASS B	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	587,798.55	9,988.27 5,871,094,309	9,685.00 5,692,828,976	11.09
6	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	5,161,621,148	1.0334 5,334,312,930	0.9792 5,054,259,428	9.84
7	ダイワ米ドル建て新興国債券ファンドM	日本	投資信託 受益証券	4,506,476,811	1.1696 5,270,864,694	1.1202 5,048,155,323	9.83
8	LM・ブランディワイン外国債券ファンド	日本	投資信託 受益証券	1,458,782,450	1.1887 1,734,179,938	1.1063 1,613,851,024	3.14

(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	79.27%
投資証券	19.75%
合計	99.02%

(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
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
第7計算期間末 (平成26年6月16日)	22,647,207,331	22,842,956,406	1.1570	1.1670
平成26年12月末日	36,054,050,700	-	1.3322	-
平成27年1月末日	37,545,826,702	-	1.3066	-
2月末日	39,806,463,773	-	1.3181	-
3月末日	42,701,975,892	-	1.3100	-
4月末日	44,592,316,430	-	1.3202	-
5月末日	47,220,204,455	-	1.3439	-
第8計算期間末 (平成27年6月15日)	48,023,500,577	48,023,500,577	1.3267	1.3267
6月末日	48,514,688,574	-	1.3133	-
7月末日	50,376,873,047	-	1.3284	-
8月末日	50,507,005,269	-	1.2953	-
9月末日	50,362,773,373	-	1.2735	-
10月末日	51,508,091,432	-	1.2975	-
11月末日	52,136,888,261	-	1.2961	-
12月末日	51,351,641,085	-	1.2643	-

【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
第7計算期間	0.0100

第8計算期間	0.0000
平成27年6月16日～ 平成27年12月15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
第7計算期間	12.0
第8計算期間	14.7
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	3.9

(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	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
第7計算期間	9,059,644,250	3,755,371,858
第8計算期間	20,937,659,533	4,313,927,580
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	7,755,476,990	3,582,441,497

(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27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	70,284,532,234	99.98
内 日本	70,284,532,234	99.98
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	17,449,809	0.02
純資産総額	70,301,982,043	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27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	31,447,218,002	2.2462 70,639,010,290	2.2350 70,284,532,234	99.98

(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	99.98%
合計	99.98%

(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
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
第7計算期間末 (平成26年6月16日)	25,372,817,916	25,574,158,566	1.2602	1.2702
平成26年12月末日	47,667,637,679	-	1.5613	-
平成27年1月末日	50,212,083,988	-	1.5627	-
2月末日	54,649,183,249	-	1.5868	-
3月末日	57,559,671,220	-	1.5682	-
4月末日	60,633,702,102	-	1.5801	-

5月末日	62,961,393,997	-	1.5720	-
第8計算期間末 (平成27年6月15日)	62,680,880,341	62,680,880,341	1.5439	1.5439
6月末日	62,687,406,840	-	1.5293	-
7月末日	61,804,711,174	-	1.4981	-
8月末日	60,542,686,396	-	1.3997	-
9月末日	62,933,820,524	-	1.4315	-
10月末日	66,117,946,474	-	1.4840	-
11月末日	68,863,633,928	-	1.5142	-
12月末日	70,301,982,043	-	1.5194	-

【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
第7計算期間	0.0100
第8計算期間	0.0000
平成27年6月16日～ 平成27年12月15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
第7計算期間	26.0
第8計算期間	22.5
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	5.4

(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	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
第7計算期間	12,515,204,872	3,962,689,494
第8計算期間	27,935,534,616	7,470,329,572

平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	11,755,739,034	6,528,723,916
----------------------------	----------------	---------------

(注) 当初設定数量は100,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

(1) 投資状況 (平成27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	76,081,900,000	97.41
内 日本	76,081,900,000	97.41
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,024,403,358	2.59
純資産総額	78,106,303,358	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27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	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	9,500	540,612.99 5,135,823,406	587,000.00 5,576,500,000	7.14
2	日本リテールファンド	日本	投資証券	19,000	230,604.30 4,381,481,737	232,200.00 4,411,800,000	5.65
3	日本ビルファンド	日本	投資証券	7,000	554,218.23 3,879,527,612	577,000.00 4,039,000,000	5.17
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	27,000	154,594.20 4,174,043,746	149,400.00 4,033,800,000	5.16
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	22,000	163,671.70 3,600,777,434	164,000.00 3,608,000,000	4.62
6	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	32,000	87,400.00 2,796,800,000	89,500.00 2,864,000,000	3.67
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	11,500	218,531.33 2,513,110,348	218,500.00 2,512,750,000	3.22
8	API投資法人	日本	投資証券	4,700	497,021.04 2,335,998,888	513,000.00 2,411,100,000	3.09
9	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	34,000	70,000.00 2,380,000,000	70,400.00 2,393,600,000	3.06
10	GLP投資法人	日本	投資証券	20,000	118,700.00 2,374,000,000	116,800.00 2,336,000,000	2.99
11	オリックス不動産投資	日本	投資証券	14,000	159,600.00 2,234,400,000	156,400.00 2,189,600,000	2.80
12	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	8,000	267,000.00 2,136,000,000	265,700.00 2,125,600,000	2.72

13	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	3,200	605,000.00 1,936,000,000	654,000.00 2,092,800,000	2.68
14	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	24,500	80,778.68 1,979,077,724	85,400.00 2,092,300,000	2.68
15	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	5,000	391,500.00 1,957,500,000	413,000.00 2,065,000,000	2.64
16	インベスコ・オフィス・リート	日本	投資証券	20,000	97,400.00 1,948,000,000	102,500.00 2,050,000,000	2.62
17	森ヒルズリート	日本	投資証券	12,000	148,881.47 1,786,577,659	155,000.00 1,860,000,000	2.38
18	産業ファンド	日本	投資証券	3,000	549,000.00 1,647,000,000	576,000.00 1,728,000,000	2.21
19	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	3,000	533,000.00 1,599,000,000	565,000.00 1,695,000,000	2.17
20	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	7,000	227,900.00 1,595,300,000	234,300.00 1,640,100,000	2.10
21	森トラスト総合リート	日本	投資証券	6,700	212,340.16 1,422,679,094	206,300.00 1,382,210,000	1.77
22	トップリート投資法人	日本	投資証券	2,800	458,000.00 1,282,400,000	457,000.00 1,279,600,000	1.64
23	大和ハウスリート	日本	投資証券	2,700	491,619.28 1,327,372,056	473,000.00 1,277,100,000	1.64
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	3,000	420,500.00 1,261,500,000	420,000.00 1,260,000,000	1.61
25	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	9,000	126,000.00 1,134,000,000	131,400.00 1,182,600,000	1.51
26	プレミア投資法人	日本	投資証券	9,500	115,900.00 1,101,050,000	123,300.00 1,171,350,000	1.50
27	日本リート投資法人	日本	投資証券	4,000	287,500.00 1,150,000,000	287,400.00 1,149,600,000	1.47
28	いちごオフィスリート投資法人	日本	投資証券	13,000	83,800.00 1,089,400,000	86,800.00 1,128,400,000	1.44
29	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	4,200	232,200.00 975,240,000	255,200.00 1,071,840,000	1.37
30	MCUBS MidCity投資法人	日本	投資証券	2,900	353,000.00 1,023,700,000	369,500.00 1,071,550,000	1.37

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.41%
合計	97.41%

(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27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	56,811,967,895	99.66
内 日本	56,811,967,895	99.66
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）	195,215,799	0.34
純資産総額	57,007,183,694	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27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	36,348,028,084	1.4814 53,848,672,491	1.5630 56,811,967,895	99.66

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.66%
合計	99.66%

(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
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
第7計算期間末 (平成26年6月16日)	20,076,527,106	20,253,220,440	1.1362	1.1462
平成26年12月末日	35,641,395,716	-	1.4797	-
平成27年1月末日	38,984,998,516	-	1.5337	-
2月末日	39,495,624,487	-	1.5039	-
3月末日	42,947,905,591	-	1.5373	-
4月末日	43,233,170,401	-	1.4834	-
5月末日	46,471,180,581	-	1.5237	-
第8計算期間末 (平成27年6月15日)	46,712,581,208	46,712,581,208	1.4830	1.4830
6月末日	46,549,856,386	-	1.4383	-
7月末日	51,153,254,546	-	1.5236	-
8月末日	50,187,138,488	-	1.4433	-
9月末日	50,821,278,228	-	1.4268	-
10月末日	55,748,449,930	-	1.5530	-
11月末日	56,271,050,443	-	1.5512	-
12月末日	57,007,183,694	-	1.5563	-

【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
第7計算期間	0.0100
第8計算期間	0.0000
平成27年6月16日～ 平成27年12月15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
第7計算期間	20.9
第8計算期間	30.5
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	1.0

(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
第7計算期間	9,974,103,152	2,837,524,588
第8計算期間	19,475,242,818	5,646,312,189
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	8,060,364,641	3,144,223,417

(注) 当初設定数量は100,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ海外REIT・マザーファンド

(1) 投資状況 (平成27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	55,502,069,708	97.15
内 香港	874,349,872	1.53
内 シンガポール	941,786,424	1.65
内 イギリス	3,517,542,487	6.16
内 オランダ	788,859,916	1.38
内 ベルギー	266,158,732	0.47
内 フランス	2,243,380,538	3.93
内 ドイツ	972,200,694	1.70
内 スペイン	620,241,637	1.09
内 イタリア	478,616,167	0.84
内 アメリカ	40,677,886,473	71.20
内 オーストラリア	4,121,046,768	7.21

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,629,976,383	2.85
純資産総額	57,132,046,091	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)	143,790,835	0.25
内 日本	143,790,835	0.25
為替予約取引(売建)	23,197,367	0.04
内 日本	23,197,367	0.04

(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27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	229,572	21,672.77 4,975,481,658	23,614.23 5,421,166,446	9.49
2	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	427,833	8,512.65 3,641,994,213	9,886.40 4,229,728,899	7.40
3	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	185,616	10,742.85 1,994,062,540	12,239.50 2,271,847,552	3.98
4	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	207,158	8,854.58 1,834,309,186	10,881.43 2,254,176,146	3.95
5	CUBESMART	アメリカ	投資証券	510,611	3,057.46 1,561,195,350	3,789.56 1,934,994,187	3.39
6	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	133,555	12,630.27 1,686,836,939	13,757.98 1,837,447,379	3.22
7	DDR CORP	アメリカ	投資証券	804,031	1,827.24 1,469,158,810	2,055.19 1,652,440,009	2.89
8	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	191,470	7,654.99 1,465,727,191	8,262.99 1,582,114,906	2.77
9	KLEPIERRE	フランス	投資証券	292,069	5,089.61 1,486,534,603	5,380.16 1,571,380,609	2.75
10	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	アメリカ	投資証券	317,530	4,341.96 1,378,702,559	4,867.81 1,545,678,758	2.71
11	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	719,678	2,125.87 1,530,029,442	1,921.31 1,382,729,792	2.42
12	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	153,589	7,156.99 1,099,236,074	8,329.32 1,279,292,943	2.24
13	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	アメリカ	投資証券	278,230	4,015.10 1,117,129,709	4,264.76 1,186,586,846	2.08
14	VICINITY CENTRES	オーストラリア	投資証券	4,685,234	239.31 1,121,435,455	249.69 1,169,869,196	2.05

15	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	57,150	16,383.30 936,310,476	18,086.67 1,033,653,511	1.81
16	MID-AMERICA APARTMENT COMM	アメリカ	投資証券	91,819	9,698.61 890,525,485	11,144.36 1,023,264,358	1.79
17	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	121,227	7,861.11 952,982,616	8,434.25 1,022,459,710	1.79
18	KILROY REALTY CORP	アメリカ	投資証券	130,447	7,929.14 1,034,345,315	7,739.54 1,009,600,257	1.77
19	GENERAL GROWTH PROPERTIES	アメリカ	投資証券	301,435	3,171.68 956,091,626	3,309.53 997,610,708	1.75
20	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	ドイツ	投資証券	595,001	1,484.38 883,212,968	1,633.94 972,200,694	1.70
21	PHYSICIANS REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	441,376	1,755.47 774,840,874	2,044.33 902,322,391	1.58
22	HAMMERSON PLC	イギリス	投資証券	807,794	1,098.42 887,427,529	1,095.02 884,556,644	1.55
23	EDUCATION REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	162,651	3,469.94 564,390,789	4,635.04 753,894,265	1.32
24	BIG YELLOW GROUP PLC	イギリス	投資証券	498,641	1,244.66 620,666,452	1,497.28 746,606,442	1.31
25	PS BUSINESS PARKS INC/CA	アメリカ	投資証券	68,946	8,925.14 615,352,702	10,729.46 739,753,735	1.29
26	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	アメリカ	投資証券	91,272	7,305.95 666,833,062	8,057.95 735,465,587	1.29
27	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	アメリカ	投資証券	151,390	4,489.58 679,688,305	4,852.14 734,565,520	1.29
28	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	1,933,622	334.97 647,715,416	374.53 724,217,237	1.27
29	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	19,562	33,870.06 662,566,268	36,783.63 719,561,523	1.26
30	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	アメリカ	投資証券	557,446	1,105.99 616,531,764	1,207.30 673,007,956	1.18

(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	97.15%
合計	97.15%

(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

(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 2016年1月	買建	1,192,394	143,722,362	143,790,835	0.25%
		英ポンド売/円買 2016年1月	売建	129,768	23,199,962	23,197,367	0.04%

(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27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	36,682,023,963	95.92
内 ケイマン諸島	36,682,023,963	95.92
親投資信託受益証券	323,366,984	0.85
内 日本	323,366,984	0.85
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,237,297,178	3.24
純資産総額	38,242,688,125	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27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	5,648,703.63	8,380.82 47,341,325,077	6,493.88 36,682,023,963	95.92
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	317,088,630	1.0196 323,335,274	1.0198 323,366,984	0.85

(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	95.92%
親投資信託受益証券	0.85%
合計	96.76%

(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
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
第7計算期間末 (平成26年6月16日)	18,180,593,065	18,180,593,065	0.6759	0.6759
平成26年12月末日	26,282,361,055	-	0.6054	-
平成27年1月末日	26,202,988,580	-	0.5400	-
2月末日	30,275,422,942	-	0.5703	-
3月末日	32,585,811,190	-	0.5536	-
4月末日	35,599,876,956	-	0.5675	-
5月末日	38,173,904,833	-	0.5792	-
第8計算期間末 (平成27年6月15日)	40,562,980,303	40,562,980,303	0.5898	0.5898
6月末日	41,069,801,687	-	0.5834	-
7月末日	39,262,467,905	-	0.5366	-
8月末日	37,828,864,601	-	0.4888	-
9月末日	38,651,726,959	-	0.4821	-
10月末日	43,136,439,363	-	0.4923	-
11月末日	42,763,212,988	-	0.4714	-
12月末日	38,242,688,125	-	0.4359	-

【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
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
平成27年6月16日～ 平成27年12月15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
第7計算期間	11.2
第8計算期間	12.7
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	25.9

(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	2,412,917,551	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
第7計算期間	15,291,163,591	4,193,808,572
第8計算期間	47,493,924,943	5,622,171,536
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	30,469,163,138	8,729,358,933

(注) 当初設定数量は100,000口です。

(参考) マザーファンド

ダイワ・マネー・マザーファンド

(1) 投資状況（平成27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	36,249,774,210	52.10
内 日本	36,249,774,210	52.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	33,325,009,370	47.90
純資産総額	69,574,783,580	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27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	563 国庫短期証券	日本	国債証券	6,100,000,000	99.99 6,099,998,978	99.99 6,099,998,978	- 2016/01/18	8.77
2	573 国庫短期証券	日本	国債証券	5,800,000,000	100.01 5,800,746,792	100.01 5,800,746,792	- 2016/03/07	8.34
3	568 国庫短期証券	日本	国債証券	5,000,000,000	100.00 5,000,000,000	100.00 5,000,000,000	- 2016/02/15	7.19
4	567 国庫短期証券	日本	国債証券	5,000,000,000	99.99 4,999,997,958	99.99 4,999,997,958	- 2016/02/08	7.19
5	576 国庫短期証券	日本	国債証券	3,000,000,000	100.00 3,000,241,456	100.00 3,000,241,456	- 2016/03/22	4.31
6	574 国庫短期証券	日本	国債証券	3,000,000,000	100.00 3,000,152,685	100.00 3,000,152,685	- 2016/03/14	4.31
7	566 国庫短期証券	日本	国債証券	3,000,000,000	99.99 2,999,998,950	99.99 2,999,998,950	- 2016/02/01	4.31
8	342 2年国債	日本	国債証券	2,094,000,000	100.08 2,095,675,200	100.07 2,095,528,620	0.100000 2016/07/15	3.01
9	578 国庫短期証券	日本	国債証券	2,000,000,000	100.00 2,000,096,271	100.00 2,000,096,271	- 2016/03/28	2.87
10	100 5年国債	日本	国債証券	1,250,000,000	100.26 1,253,250,000	100.24 1,253,012,500	0.300000 2016/09/20	1.80

(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	52.10%
合計	52.10%

(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) 投資信託証券

Daiwa " RICI " Fund

(1) 有価証券(平成27年12月30日現在)

(単位: USドル)

銘柄名	券面総額	評価額	備考
US T-BILL OPCT 26MAY16	34,000,000	33,973,394.59	
US T-BILL OPCT 28APR16	30,500,000	30,481,657.99	
USD T-BILL OPCT 14APR16	27,000,000	26,981,742.97	
US T-BILL OPCT 07JAN16	25,000,000	24,999,531.96	
US T-BILL OPCT 9JUN16	24,000,000	23,944,579.99	
TREASURY BILL US GOV OPCT 04FEB16	23,000,000	22,997,033.20	
TREASURY BILL US GOV OPCT 03MAR16	23,000,000	22,993,246.27	
US TREASURY BILL OPCT 31MAR16	23,000,000	22,989,175.96	

(2) 商品先物(平成27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-16	買建	340	-222,595.43	
RAPESEED EURO FUT (EOP) FEB-16	買建	162	58,285.74	
BRENT CRUDE OIL (ICE) FEB-16	買建	935	-6,147,050.00	
COFFEE ROBUSTA (ICE) MAR-16	買建	424	19,290.00	
COPPER GRADE A (LME) JAN-16	買建	114	-1,190,643.75	
COPPER GRADE A (LME) JAN-16	売建	114	-274,550.00	
COPPER GRADE A (LME) FEB-16	買建	120	304,500.00	
COPPER GRADE A (LME) FEB-16	売建	6	-9,825.00	
GAS OIL (ICE) FEB-16	買建	91	-643,225.00	
NO 7 COCOA (ICE) MAR-16	買建	96	92,332.51	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-16	買建	399	488,875.00	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-16	売建	399	-605,300.00	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) FEB-16	買建	377	612,312.50	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) FEB-16	売建	18	-19,950.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-16	買建	58	-541,938.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-16	売建	58	113,607.00	
PRIMARY NICKEL (LME) FEB-16	買建	65	-126,462.00	
PRIMARY NICKEL (LME) FEB-16	売建	3	1,338.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-16	買建	171	-643,068.75	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-16	売建	171	58,425.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) FEB-16	買建	178	-66,775.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) FEB-16	売建	9	-3,431.25	
STANDARD LEAD (LME) JAN-16	買建	170	219,481.25	
STANDARD LEAD (LME) JAN-16	売建	170	-417,287.50	
STANDARD LEAD (LME) FEB-16	買建	170	414,112.50	
STANDARD LEAD (LME) FEB-16	売建	8	-9,093.75	
TIN (LME) JAN-16	買建	49	-90,410.00	
TIN (LME) JAN-16	売建	49	128,925.00	
TIN (LME) FEB-16	買建	46	-119,125.00	
TIN (LME) FEB-16	売建	2	1,220.00	
WHITE SUGAR (ICE) MAR-16	買建	162	118,500.00	
RUBBER (TCM) MAY-16	買建	494	-31,841.05	
CORN (CBT) MAR-16	買建	847	-1,000,950.00	
COTTON NO 2 (NYB) MAR-16	買建	430	171,335.00	
FROZEN CONCENTRATED ORANGE JUICE (NYB) MAR-16	買建	92	84,690.00	
GASOLINE RBOB FUT (NYM) FEB-16	買建	175	-369,331.20	
GOLD (CMX) FEB-16	買建	155	-948,540.00	
HEATING OIL (NYM) FEB-16	買建	100	-992,628.00	
HENRY HUB NATURAL GAS (NYM) FEB-16	買建	723	-1,336,530.00	
LEAN HOGS (CME) FEB-16	買建	142	-224,370.00	
LIGHT SWEET CRUDE OIL (NYM) FEB-16	買建	1,217	-5,318,700.00	
LIVE CATTLE (CME) FEB-16	買建	122	-309,940.00	
LUMBER (CME) MAR-16	買建	120	293,491.00	
MILK FUTURE (CME) JAN-16	買建	11	-22,620.00	

銘柄名	買建/売建	数量	評価損益	備考
OAT (CBT) MAR-16	買建	141	-54,150.00	
PALLADIUM (NYM) MAR-16	買建	18	-155,750.00	
PLATINUM (NYM) APR-16	買建	141	354,555.00	
ROUGH RICE (CBT) MAR-16	買建	100	-166,020.00	
SILVER (CMX) MAR-16	買建	186	-947,810.00	
SOYBEAN MEAL (CBT) MAR-16	買建	86	-150,860.00	
SOYBEAN OIL (CBT) MAR-16	買建	372	175,884.00	
SOYBEANS (CBT) MAR-16	買建	262	-227,312.50	
SUGAR NO 11 WORLD (NYB) MAR-16	買建	195	630,246.40	
WHEAT (CBT) MAR-16	買建	649	-1,638,625.00	
WHEAT (CBT) MAR-16	買建	140	-254,412.50	

(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27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	102,725,267,807	89.24
内 日本	102,725,267,807	89.24
投資証券	11,583,654,510	10.06
内 アイルランド	11,583,654,510	10.06
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	802,705,802	0.70
純資産総額	115,111,628,119	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27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	34,444,497,395	1.1548 39,776,819,115	1.1582 39,893,616,882	34.66
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	27,061,754,285	1.0532 28,503,805,928	1.0542 28,528,501,367	24.78
3	NB US LONG SHORT EQUITY FUND JPY CLASS	アイルランド	投資証券	11,977,969.26	1,015.98 12,169,450,842	967.08 11,583,654,510	10.06
4	ニッセイ・グローバル・ボンド・オポチュ ニティ	日本	投資信託 受益証券	11,573,953,833	0.9945 11,511,000,238	0.9907 11,466,316,062	9.96
5	シンプレクス・イベントドリブン・ファンド	日本	投資信託 受益証券	10,439,648,329	1.0942 11,424,027,933	1.0969 11,451,250,252	9.95
6	T & D米国金利戦略ファンド	日本	投資信託 受益証券	11,291,860,800	1.0016 11,310,783,713	1.0083 11,385,583,244	9.89

(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	89.24%
投資証券	10.06%
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)	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
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
第7計算期間末 (平成26年6月16日)	37,079,833,258	37,079,833,258	0.9996	0.9996
平成26年12月末日	62,442,713,912	-	1.0179	-
平成27年1月末日	68,100,568,721	-	1.0163	-
2月末日	73,174,865,378	-	1.0173	-
3月末日	80,262,784,014	-	1.0145	-
4月末日	86,522,814,334	-	1.0178	-
5月末日	92,099,256,941	-	1.0179	-
第8計算期間末 (平成27年6月15日)	96,308,493,928	96,308,493,928	1.0208	1.0208
6月末日	98,708,468,400	-	1.0186	-
7月末日	103,101,993,631	-	1.0172	-

8月末日	107,032,037,872	-	1.0100	-
9月末日	108,823,386,711	-	1.0031	-
10月末日	110,901,264,174	-	1.0105	-
11月末日	113,481,450,303	-	1.0119	-
12月末日	115,111,628,119	-	1.0105	-

【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
第7計算期間	0.0000
第8計算期間	0.0000
平成27年6月16日～ 平成27年12月15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
第7計算期間	1.5
第8計算期間	2.1
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	0.9

(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	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
第7計算期間	21,941,355,998	4,487,455,644
第8計算期間	65,119,330,062	7,868,002,016
平成27年6月16日～ 平成27年12月15日	27,433,233,246	8,677,980,985

(注) 当初設定数量は100,000口です。

[次へ](#)

(参考情報) 運用実績

ダイワファンドラップ 日本株式セレクト

2015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	13,141円
純資産総額	2,522億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-2.1%
3カ月間	11.8%
6カ月間	-2.7%
1年間	8.2%
3年間	107.4%
5年間	117.4%
設定来	31.4%



※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	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8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	14年6月	15年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

※分配金は、収益配分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。

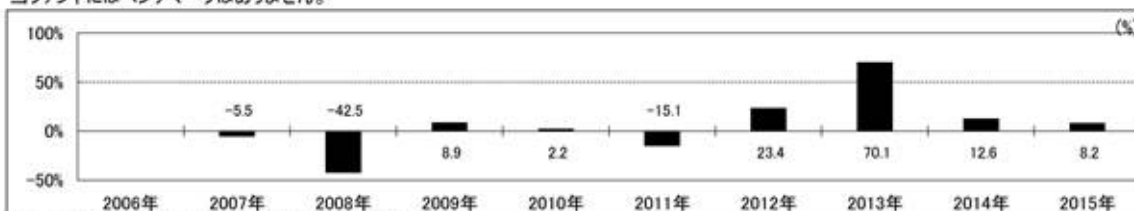
主要な資産の状況

※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
大和証券投資信託委託	ダイワ・パリュール株・オープン	19.8%
大和証券投資信託委託	ダイワ・スマート日本株ファンダメンタル・ファンド	18.8%
SBIアセットマネジメント	SBI/アリアンツ日本株集中投資戦略ファンド	15.9%
DIAMアセットマネジメント	DIAM国内株式アクティブ市場型ファンド	12.9%
シンプレクス・アセット・マネジメント	J Flag 中小型株ファンド	8.1%
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	7.9%
大和住銀投信投資顧問	大和住銀ニッポン中小型株ファンド	5.0%
JPMorgan・アセット・マネジメント	GIM日本株・ファンド	5.0%
T&Dアセットマネジメント	T&D/マイルストーン日本株ファンド	3.0%
大和証券投資信託委託	ダイワ好配当日本株投信Q	3.0%
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、2015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。

(参考情報) 運用実績

ダイワファンドラップ 日本債券セレクト

2015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	11,231円
純資産総額	4,274億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.6%
3カ月間	0.7%
6カ月間	1.2%
1年間	0.3%
3年間	5.2%
5年間	8.3%
設定来	12.3%



※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	第7期	第8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	14年6月	15年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

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

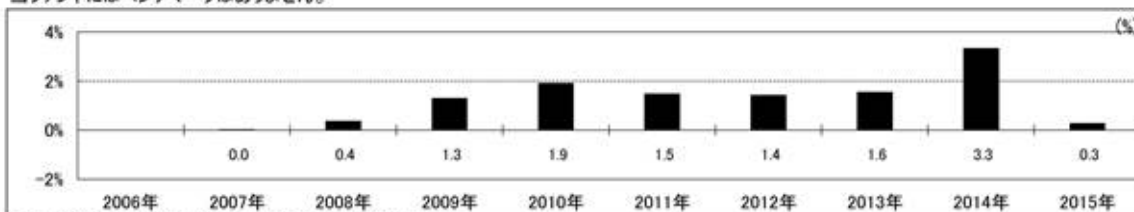
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
マニライフ・インベストメンツ・ジャパン	マニライフ日本債券アクティブ・ファンドM	32.8%
明治安田アセットマネジメント	明治安田日本債券アクティブ・ファンド	26.8%
大和証券投資信託委託	ダイワ・ダイナミック日本債券ファンド	14.9%
新光投信	国内債券スイッチング戦略ファンド	11.9%
損保ジャパン日本興亜アセットマネジメント	損保ジャパン日本興亜RMBSファンド	5.0%
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	5.0%
東京海上アセットマネジメント	東京海上日本債ファンドM	3.0%
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、2015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。

(参考情報) 運用実績

ダイワファンドラップ 外国株式セレクト

2015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	11,924円
純資産総額	1,588億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-3.7%
3カ月間	7.7%
6カ月間	-6.6%
1年間	-1.0%
3年間	79.8%
5年間	105.5%
設定来	19.2%



※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	第7期	第8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	14年6月	15年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

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

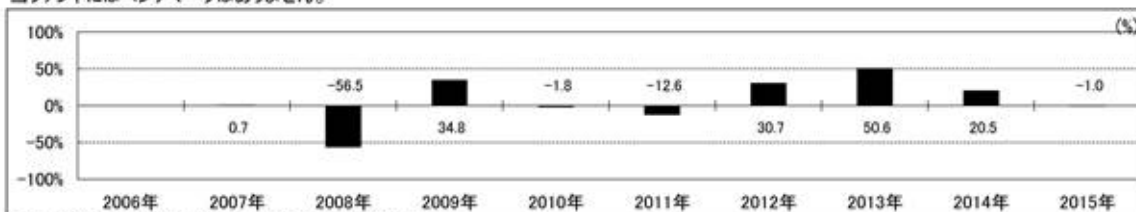
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
大和証券投資信託委託	ダイワ/ウエリントン・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	29.6%
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	19.8%
ニッセイアセットマネジメント	ニッセイ/アリアンツ・欧州グロース株式ファンド	18.1%
大和証券投資信託委託	ダイワ・スマート米国株モメンタム・ファンド	14.7%
レグ・メイソン・アセット・マネジメント	LM・クリアプリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・ファンド	12.8%
大和住銀投信投資顧問	T.R.P欧州株式オープン	2.0%
ニッセイアセットマネジメント	ニッセイ/ボストン・カンパニー・米国株ファンド	2.0%
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、2015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。

(参考情報) 運用実績

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

2015年12月30日現在

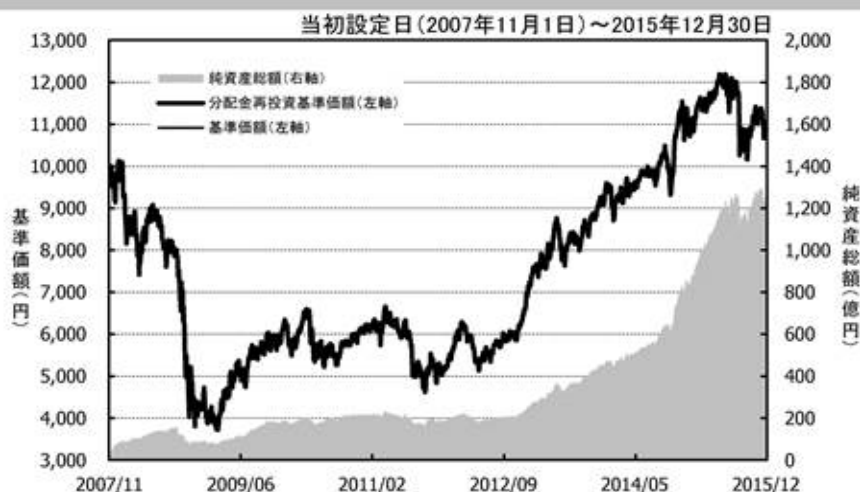
※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,874円
純資産総額	1,250億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-4.2%
3カ月間	7.0%
6カ月間	-9.1%
1年間	-4.5%
3年間	63.1%
5年間	80.3%
設定来	8.7%



※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	第7期	第8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	14年6月	15年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

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

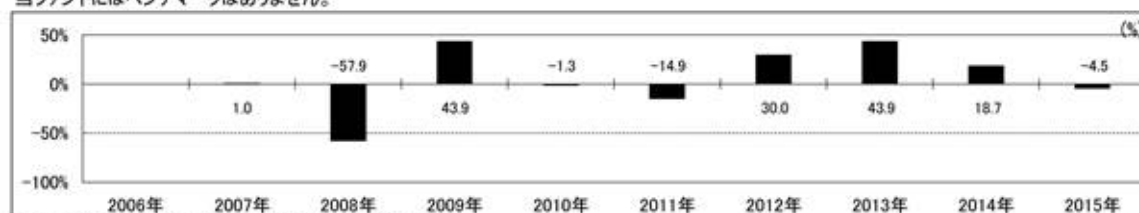
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

組入上位10ファンド		
運用会社名	ファンド名	比率
大和証券投資信託委託	ダイワ/ウエリントン・グローバル・オポチュニティーズ・ファンド	23.7%
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	15.8%
ニッセイアセットマネジメント	ニッセイ/アリアンツ・欧州グロース株ファンド	14.4%
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	11.9%
大和証券投資信託委託	ダイワ・スマート米国株モメンタム・ファンド	11.8%
レグ・メイソン・アセット・マネジメント	LM・クリアブリッジ米国ミッド・キャップ・グロース・ファンド	10.2%
大和証券投資信託委託	ダイワ新興国株式ファンド	8.0%
ニッセイアセットマネジメント	ニッセイ/ボストン・カンパニー・米国株ファンド	1.6%
大和住銀投信投資顧問	T.R.P欧州株式オープン	1.6%
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、2015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。

(参考情報) 運用実績

ダイワファンドラップ 外国債券セレクト

2015年12月30日現在

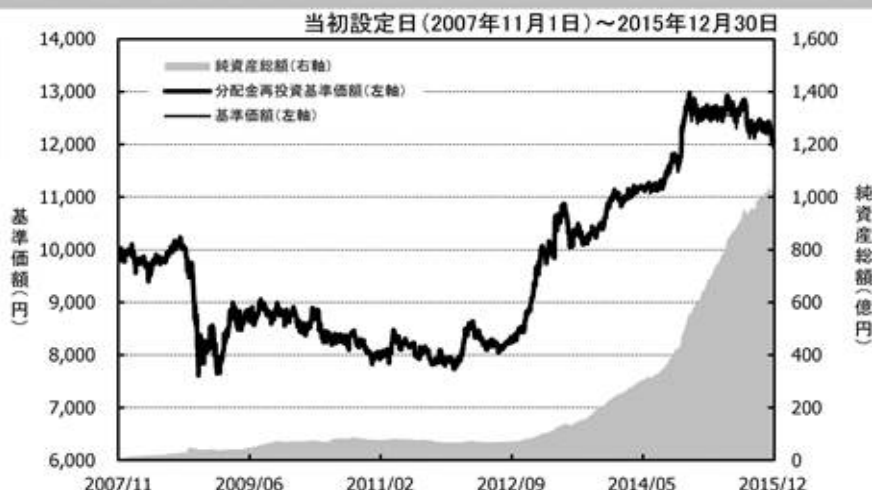
※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	11,962円
純資産総額	1,021億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	-2.1%
3か月間	-1.3%
6か月間	-3.8%
1年間	-6.2%
3年間	30.6%
5年間	53.6%
設定来	20.7%



※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: 100円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8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	14年6月	15年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	100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。

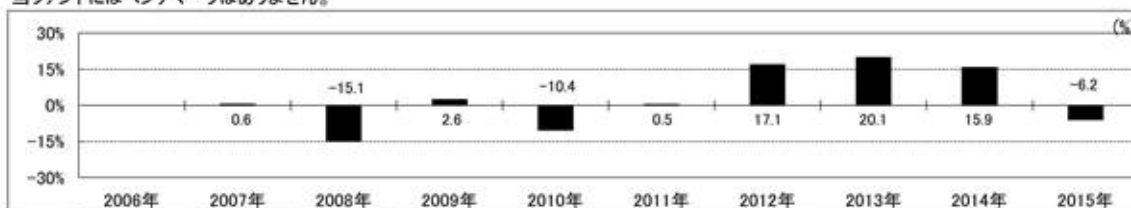
主要な資産の状況

※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
ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・インターナショナル	ゴールドマン・サックス・グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオⅡ	24.6%
大和証券投資信託委託	ダイワ欧州債券ファンド	22.0%
ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン	グローバル・コア債券ファンド	19.6%
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	14.9%
ウエリントン・マネジメント・カンパニー・エルエルピー	ウエリントン・マネジメント・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	13.7%
レグ・メイソン・アセット・マネジメント	LM・ブランディワイン外国債券ファンド	4.0%
合計		98.9%

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、2015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。

(参考情報) 運用実績

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

2015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	12,643円
純資産総額	513億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-2.5%
3カ月間	-0.7%
6カ月間	-3.7%
1年間	-5.1%
3年間	32.3%
5年間	58.1%
設定来	27.5%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
※基準価額の計算において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: 100円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8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	14年6月	15年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	100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。

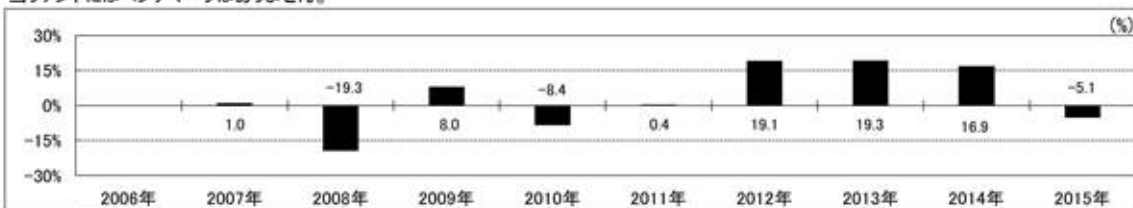
主要な資産の状況

※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
ゴールドマン・サックス・アセット・マネジメント・インターナショナル	ゴールドマン・サックス・グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオⅡ	19.7%
大和証券投資信託委託	ダイワ欧州債券ファンド	17.6%
ブルデンシャル・インベストメント・マネジメント・ジャパン	グローバル・コア債券ファンド	15.8%
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	12.0%
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	11.1%
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	9.8%
大和証券投資信託委託	ダイワ米ドル建て新興国債券ファンドM	9.8%
レッグ・メイソン・アセット・マネジメント	LM・ブランディワイン外国債券ファンド	3.1%
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、2015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。

(参考情報) 運用実績

ダイワファンドラップ J-REITセレクト

2015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	15,194円
純資産総額	703億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.3%
3カ月間	6.1%
6カ月間	-0.6%
1年間	-2.7%
3年間	80.9%
5年間	101.1%
設定来	53.1%



※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: 100円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8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	14年6月	15年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	100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

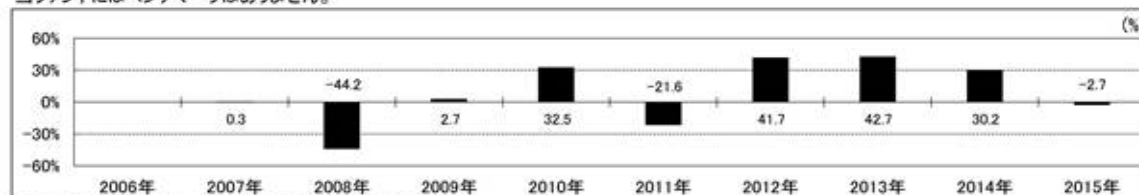
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	比率
国内リート	50	97.4%	オフィス不動産	30.7%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産	7.1%
			各種不動産	27.4%	日本リテールファンド	店舗用不動産	5.6%
			住宅用不動産	13.7%	日本ビルファンド	オフィス不動産	5.2%
			工業用不動産	10.5%	野村不動産マスターF	各種不動産	5.2%
			店舗用不動産	9.8%	ユナイテッド・アーバン投資法人	各種不動産	4.6%
			ホテル・リゾート不動産	4.6%	ジャパン・ホテル・リート投資法人	ホテル・リゾート不動産	3.7%
			ヘルスケア不動産	0.6%	日本プロジスリート	工業用不動産	3.2%
					API投資法人	各種不動産	3.1%
					インヴィンシブル投資法人	住宅用不動産	3.1%
コール・ローン、その他		2.6%			GLP投資法人	工業用不動産	3.0%
合計	50	100.0%	合計	97.4%	合計		43.8%

※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、2015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。

(参考情報) 運用実績

ダイワファンドラップ 外国REITセレクト

2015年12月30日現在

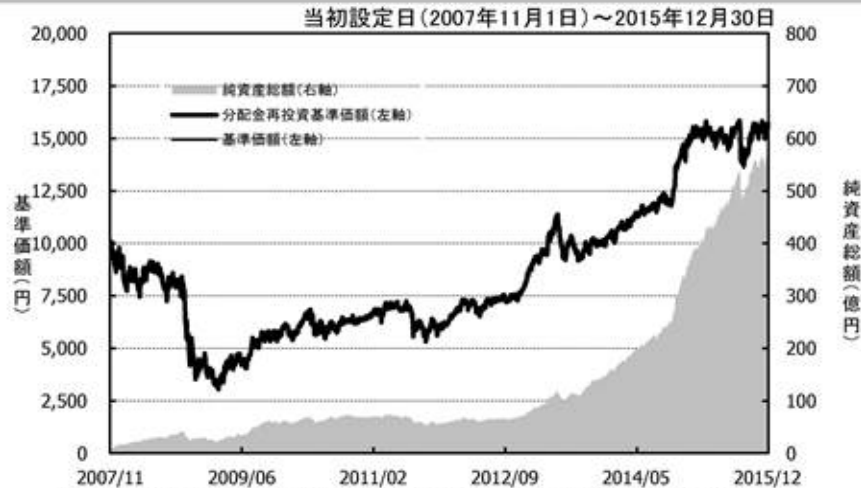
※過去の実績を示したものであり、将来の成果を示唆・保証するものではありません。

基準価額・純資産の推移

基準価額	15,563円
純資産総額	570億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.3%
3カ月間	9.1%
6カ月間	8.2%
1年間	5.2%
3年間	88.6%
5年間	146.5%
設定来	57.0%



※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: 100円

決算期	第1期	第2期	第3期	第4期	第5期	第6期	第7期	第8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	14年6月	15年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	100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。

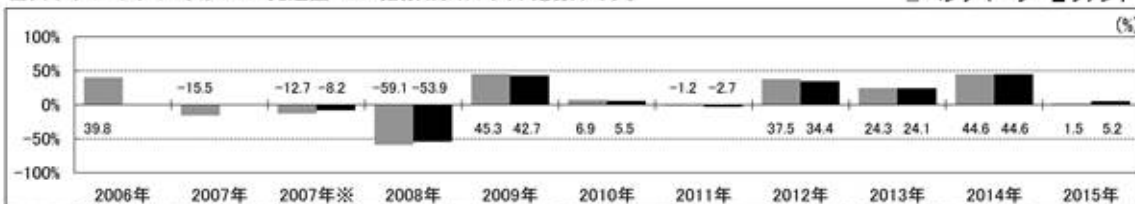
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート	57	96.8%	米ドル	72.7%	商業施設	34.5%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	9.5%
			ユーロ	9.4%	住宅	17.8%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	7.4%
			豪ドル	7.7%	オフィス	9.8%	VORNADO REALTY TRUST	各種不動産	アメリカ	4.0%
コル・ローン、その他		3.2%	英ポンド	6.4%	貸倉庫	9.5%	EXTRA SPACE STORAGE INC	貸倉庫	アメリカ	3.9%
合計	57	100.0%	香港ドル	2.5%	各種不動産	8.9%	CUBESMART	貸倉庫	アメリカ	3.4%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	0.8%	ヘルスクア	7.1%	SL GREEN REALTY CORP	オフィス	アメリカ	3.2%
アメリカ		71.0%	日本円	0.5%	ホテル/リゾート	3.4%	DDR CORP	商業施設	アメリカ	2.9%
オーストラリア		7.2%	カナダ・ドル	0.0%	特殊用途施設	2.5%	WELLTOWER INC	ヘルスクア	アメリカ	2.8%
イギリス		6.1%			産業施設	1.5%	KLEPIERRE	商業施設	フランス	2.7%
フランス		3.9%			その他	1.9%	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	住宅	アメリカ	2.7%
その他		8.6%								
合計		96.8%	合計	100.0%	合計	96.8%	合計			42.4%

※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。ベンチマークの「年間収益率」は上記ベンチマークのデータに基づき当社が計算したものです。

・2007年注は設定日(11月1日)から年末、2015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。

(参考情報) 運用実績

ダイワファンドラップ コモディティセレクト

2015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	4,359円
純資産総額	382億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-7.5%
3カ月間	-9.6%
6カ月間	-25.3%
1年間	-28.0%
3年間	-25.2%
5年間	-26.1%
設定来	-54.5%



※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	第7期	第8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	14年6月	15年6月			
分配金	500円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

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

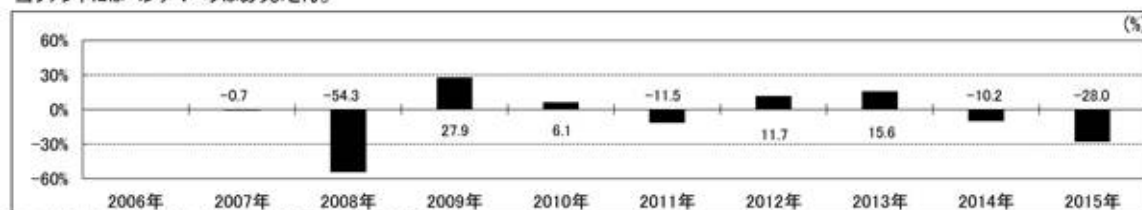
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

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	95.9%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネー・マザーファンド	0.8%
合計		96.8%

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、2015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。

(参考情報) 運用実績

ダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクト

2015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	10,105円
純資産総額	1,151億円

基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.1%
3カ月間	0.7%
6カ月間	-0.8%
1年間	-0.7%
3年間	2.5%
5年間	3.6%
設定来	1.1%



※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	第7期	第8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	14年6月	15年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円	0円			

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

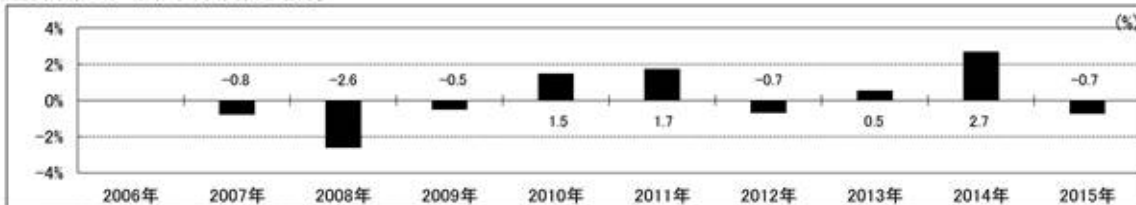
主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

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	34.7%
大和証券投資信託委託	ダイワ・トピックス・ニュートラル	24.8%
ニューパーガー・パーマン・ヨーロッパ・リミテッド	ニューパーガー・パーマンUSロング・ショート・エクイティ・ファンド	10.1%
ニッセイアセットマネジメント	ニッセイ・グローバル・ボンド・オポチュニティ	10.0%
シンプレクス・アセット・マネジメント	シンプレクス・イベントドリブン・ファンド	9.9%
T&Dアセットマネジメント	T&D米圏金利戦略ファンド	9.9%
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、2015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27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,411,875,366
投資信託受益証券		241,039,514,827
未収入金		2,200,000,000
流動資産合計		246,651,390,193
資産合計		246,651,390,193
負債の部		
流動負債		
未払解約金		250,519,387
未払受託者報酬		49,630,312
未払委託者報酬		496,303,662
その他未払費用		1,094,153
流動負債合計		797,547,514
負債合計		797,547,514
純資産の部		
元本等		
元本	1	189,182,767,871
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		56,671,074,808
（分配準備積立金）		40,489,907,942
元本等合計		245,853,842,679
純資産合計		245,853,842,679
負債純資産合計		246,651,390,193

[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27年6月16日 至 平成27年12月15日 金額(円)
営業収益	
受取配当金	626,773,436
受取利息	921,549
有価証券売買等損益	11,425,394,281
営業収益合計	10,797,699,296
営業費用	
受託者報酬	49,630,312
委託者報酬	496,303,662
その他費用	1,094,153
営業費用合計	547,028,127
営業利益又は営業損失()	11,344,727,423
経常利益又は経常損失()	11,344,727,423
中間純利益又は中間純損失()	11,344,727,423
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()	860,977,199
期首剰余金又は期首欠損金()	58,483,947,458
剰余金増加額又は欠損金減少額	15,547,687,755
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	15,547,687,755
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,876,810,181
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	6,876,810,181
中間剰余金又は中間欠損金()	56,671,074,808

[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27年6月16日 至 平成27年12月15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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
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27年12月15日現在
1. 1期首元本額	158,298,789,602円
期中追加設定元本額	49,817,103,933円
期中一部解約元本額	18,933,125,664円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	189,182,767,871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27年6月16日 至 平成27年12月15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27年12月15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27年12月15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27年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.2996円
(1万口当たり純資産額)	(12,996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27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		4,871,580,969
投資信託受益証券		414,382,284,744
未収入金		4,000,000,000
流動資産合計		423,253,865,713
資産合計		423,253,865,713
負債の部		
流動負債		
未払解約金		483,852,299
未払受託者報酬		62,012,311
未払委託者報酬		620,123,465
その他未払費用		1,080,365
流動負債合計		1,167,068,440
負債合計		1,167,068,440
純資産の部		
元本等		
元本	1	377,263,380,166
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		44,823,417,107
（分配準備積立金）		1,854,395,444
元本等合計		422,086,797,273
純資産合計		422,086,797,273
負債純資産合計		423,253,865,713

[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27年6月16日 至 平成27年12月15日 金額(円)
営業収益	
受取配当金	158,990,065
受取利息	1,619,262
有価証券売買等損益	5,745,533,711
営業収益合計	5,906,143,038
営業費用	
受託者報酬	62,012,311
委託者報酬	620,123,465
その他費用	1,080,365
営業費用合計	683,216,141
営業利益	5,222,926,897
経常利益	5,222,926,897
中間純利益	5,222,926,897
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	383,590,166
期首剰余金又は期首欠損金()	33,412,292,334
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,084,882,961
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	11,084,882,961
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,513,094,919
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	4,513,094,919
中間剰余金又は中間欠損金()	44,823,417,107

[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27年6月16日 至 平成27年12月15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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
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27年12月15日現在
1. 1期首元本額	321,732,844,658円
期中追加設定元本額	98,558,256,610円
期中一部解約元本額	43,027,721,102円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	377,263,380,166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27年6月16日 至 平成27年12月15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27年12月15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27年12月15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27年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.1188円
(1万口当たり純資産額)	(11,188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27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		2,150,392,940
投資信託受益証券		154,793,889,465
未収入金		410,000,000
流動資産合計		157,354,282,405
資産合計		157,354,282,405
負債の部		
流動負債		
未払解約金		744,647,586
未払受託者報酬		31,375,494
未払委託者報酬		313,755,379
その他未払費用		1,066,814
流動負債合計		1,090,845,273
負債合計		1,090,845,273
純資産の部		
元本等		
元本	1	133,276,617,691
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		22,986,819,441
（分配準備積立金）		22,107,222,298
元本等合計		156,263,437,132
純資産合計		156,263,437,132
負債純資産合計		157,354,282,405

[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27年6月16日 至 平成27年12月15日 金額(円)
営業収益	
受取利息	784,564
有価証券売買等損益	12,444,024,895
営業収益合計	12,443,240,331
営業費用	
受託者報酬	31,375,494
委託者報酬	313,755,379
その他費用	1,446,279
営業費用合計	346,577,152
営業利益又は営業損失()	12,789,817,483
経常利益又は経常損失()	12,789,817,483
中間純利益又は中間純損失()	12,789,817,483
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()	655,707,579
期首剰余金又は期首欠損金()	29,819,213,094
剰余金増加額又は欠損金減少額	9,149,557,512
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	9,149,557,512
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,847,841,261
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,847,841,261
中間剰余金又は中間欠損金()	22,986,819,441

[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27年6月16日 至 平成27年12月15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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。

(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27年12月15日現在
1. 1期首元本額	105,289,910,983円
期中追加設定元本額	41,991,842,590円
期中一部解約元本額	14,005,135,882円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	133,276,617,691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27年6月16日 至 平成27年12月15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27年12月15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

区 分	当中間計算期間末 平成27年12月15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27年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1725円 (11,725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27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		218,088,000
コール・ローン		1,677,664,719
投資信託受益証券		105,782,041,920
投資証券		14,092,274,930
未収入金		701,000,000
流動資産合計		122,471,069,569
資産合計		122,471,069,569
負債の部		
流動負債		
未払金		218,088,000
未払解約金		912,476,259
未払受託者報酬		26,330,320
未払委託者報酬		263,303,732
その他未払費用		1,078,871
流動負債合計		1,421,277,182
負債合計		1,421,277,182
純資産の部		
元本等		
元本	1	113,450,148,428
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		7,599,643,959
（分配準備積立金）		23,206,192,040
元本等合計		121,049,792,387
純資産合計		121,049,792,387
負債純資産合計		122,471,069,569

[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27年6月16日 至 平成27年12月15日 金額(円)
営業収益	
受取配当金	171,968,878
受取利息	555,062
有価証券売買等損益	14,101,768,134
為替差損益	317,396,892
営業収益合計	14,246,641,086
営業費用	
受託者報酬	26,330,320
委託者報酬	263,303,732
その他費用	1,458,336
営業費用合計	291,092,388
営業利益又は営業損失()	14,537,733,474
経常利益又は経常損失()	14,537,733,474
中間純利益又は中間純損失()	14,537,733,474
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()	747,576,188
期首剰余金又は期首欠損金()	20,235,895,606
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,310,989,003
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	3,310,989,003
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,157,083,364
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	2,157,083,364
中間剰余金又は中間欠損金()	7,599,643,959

[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27年6月16日 至 平成27年12月15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</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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	<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>

(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27年12月15日現在
1. 1期首元本額	99,631,731,402円

期中追加設定元本額	24,809,299,760円
期中一部解約元本額	10,990,882,734円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	113,450,148,428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27年6月16日 至 平成27年12月15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27年12月15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27年12月15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27年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0670円 (10,670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27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		529,028,291
コール・ローン		1,259,155,246
投資信託受益証券		76,330,071,543
投資証券		24,527,253,372
流動資産合計		102,645,508,452
資産合計		102,645,508,452
負債の部		
流動負債		
未払金		375,596,000
未払解約金		100,149,281
未払受託者報酬		20,529,997
未払委託者報酬		205,300,477
その他未払費用		1,083,285
流動負債合計		702,659,040
負債合計		702,659,040
純資産の部		
元本等		
元本	1	84,399,032,918
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		17,543,816,494
（分配準備積立金）		6,608,235,422
元本等合計		101,942,849,412
純資産合計		101,942,849,412
負債純資産合計		102,645,508,452

[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27年6月16日 至 平成27年12月15日 金額(円)
営業収益	
受取配当金	1,025,330,554
受取利息	518,037
有価証券売買等損益	4,446,498,706
為替差損益	474,631,346
営業収益合計	3,895,281,461
営業費用	
受託者報酬	20,529,997
委託者報酬	205,300,477
その他費用	1,315,284
営業費用合計	227,145,758
営業利益又は営業損失()	4,122,427,219
経常利益又は経常損失()	4,122,427,219
中間純利益又は中間純損失()	4,122,427,219
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()	153,369,622
期首剰余金又は期首欠損金()	17,569,153,754
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,678,363,765
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	5,678,363,765
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,734,643,428
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,734,643,428
中間剰余金又は中間欠損金()	17,543,816,494

[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27年6月16日 至 平成27年12月15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</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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。</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	<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>

(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27年12月15日現在
1. 1期首元本額	67,333,216,964円

期中追加設定元本額	23,777,422,338円
期中一部解約元本額	6,711,606,384円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	84,399,032,918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27年6月16日 至 平成27年12月15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27年12月15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27年12月15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27年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2079円 (12,079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27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		135,715,254
コール・ローン		645,499,264
投資信託受益証券		40,947,568,076
投資証券		9,993,819,516
流動資産合計		51,722,602,110
資産合計		51,722,602,110
負債の部		
流動負債		
未払金		72,696,000
未払解約金		52,572,496
未払受託者報酬		10,964,123
未払委託者報酬		109,641,729
その他未払費用		1,075,203
流動負債合計		246,949,551
負債合計		246,949,551
純資産の部		
元本等		
元本	1	40,371,675,015
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		11,103,977,544
（分配準備積立金）		5,513,576,295
元本等合計		51,475,652,559
純資産合計		51,475,652,559
負債純資産合計		51,722,602,110

[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27年6月16日 至 平成27年12月15日 金額(円)
営業収益	
受取配当金	667,546,659
受取利息	243,016
有価証券売買等損益	2,367,768,344
為替差損益	210,165,195
営業収益合計	1,910,143,864
営業費用	
受託者報酬	10,964,123
委託者報酬	109,641,729
その他費用	1,307,202
営業費用合計	121,913,054
営業利益又は営業損失()	2,032,056,918
経常利益又は経常損失()	2,032,056,918
中間純利益又は中間純損失()	2,032,056,918
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()	78,349,970
期首剰余金又は期首欠損金()	11,824,861,055
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,398,640,150
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	2,398,640,150
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,165,816,713
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,165,816,713
中間剰余金又は中間欠損金()	11,103,977,544

[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27年6月16日 至 平成27年12月15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</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>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。</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	<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>

(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27年12月15日現在
1. 1期首元本額	36,198,639,522円

期中追加設定元本額	7,755,476,990円
期中一部解約元本額	3,582,441,497円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	40,371,675,015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27年6月16日 至 平成27年12月15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27年12月15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27年12月15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27年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2750円 (12,750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27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		325,809,885
親投資信託受益証券		66,926,044,537
流動資産合計		67,251,854,422
資産合計		67,251,854,422
負債の部		
流動負債		
未払解約金		87,161,177
未払受託者報酬		13,659,871
未払委託者報酬		204,898,703
その他未払費用		1,068,322
流動負債合計		306,788,073
負債合計		306,788,073
純資産の部		
元本等		
元本	1	45,826,285,171
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		21,118,781,178
（分配準備積立金）		8,665,554,368
元本等合計		66,945,066,349
純資産合計		66,945,066,349
負債純資産合計		67,251,854,422

[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27年6月16日 至 平成27年12月15日 金額(円)
営業収益	
受取利息	81,112
有価証券売買等損益	3,207,990,972
営業収益合計	3,207,909,860
営業費用	
受託者報酬	13,659,871
委託者報酬	204,898,703
その他費用	1,068,322
営業費用合計	219,626,896
営業利益又は営業損失()	3,427,536,756
経常利益又は経常損失()	3,427,536,756
中間純利益又は中間純損失()	3,427,536,756
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()	502,803,135
期首剰余金又は期首欠損金()	22,081,610,288
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,460,280,033
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	5,460,280,033
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,498,375,522
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,498,375,522
中間剰余金又は中間欠損金()	21,118,781,178

[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27年6月16日 至 平成27年12月15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27年12月15日現在
1. 1期首元本額	40,599,270,053円
期中追加設定元本額	11,755,739,034円
期中一部解約元本額	6,528,723,916円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	45,826,285,171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27年6月16日 至 平成27年12月15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27年12月15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27年12月15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27年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.4608円

(1万口当たり純資産額)

(14,608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27年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,039,421,963
投資証券		73,147,883,000
未収入金		255,832,777
未収配当金		374,491,350
流動資産合計		74,817,629,090
資産合計		74,817,629,090
負債の部		
流動負債		
未払金		242,003,746
未払解約金		13,400,000
流動負債合計		255,403,746
負債合計		255,403,746
純資産の部		
元本等		
元本	1	34,709,200,297
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		39,853,025,047
元本等合計		74,562,225,344
純資産合計		74,562,225,344
負債純資産合計		74,817,629,090

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27年6月16日 至 平成27年12月15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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
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27年12月15日現在
1. 1期首 期首元本額	平成27年6月16日 31,433,331,539円

期中追加設定元本額	4,643,299,434円
期中一部解約元本額	1,367,430,676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)	29,522,489円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	30,381,971円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	143,559,636円
6資産バランスファンド(分配型)	258,908,668円
6資産バランスファンド(成長型)	522,635,085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)	27,431,900円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	85,398,333円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	3,360,756円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	90,850,951円
成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-07	163,914,901円
成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-08	130,330,850円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	166,847,811円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	222,033,190円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	267,180,814円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	369,205,511円
ダイワファンドラップJ-REITセレクト	31,154,475,625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)	189,810,800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)	52,723,400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)	322,101,210円
ダイワJリート・ファンド	478,526,396円
計	34,709,200,297円
2. 期末日における受益権の総数	34,709,200,297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27年12月15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27年12月15日現在

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

平成27年12月15日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,148円 (21,482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27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		586,024,580
親投資信託受益証券		54,286,341,889
流動資産合計		54,872,366,469
資産合計		54,872,366,469
負債の部		
流動負債		
未払解約金		56,150,248
未払受託者報酬		11,222,320
未払委託者報酬		238,475,630
その他未払費用		1,079,142
流動負債合計		306,927,340
負債合計		306,927,340
純資産の部		
元本等		
元本	1	36,414,405,332
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		18,151,033,797
（分配準備積立金）		8,947,808,784
元本等合計		54,565,439,129
純資産合計		54,565,439,129
負債純資産合計		54,872,366,469

[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27年6月16日 至 平成27年12月15日 金額(円)
営業収益	
受取利息	122,004
有価証券売買等損益	828,184,610
営業収益合計	828,306,614
営業費用	
受託者報酬	11,222,320
委託者報酬	1 238,475,630
その他費用	1,079,142
営業費用合計	250,777,092
営業利益	577,529,522
経常利益	577,529,522
中間純利益	577,529,522
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	53,190,342
期首剰余金又は期首欠損金()	15,214,317,100
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,930,414,795
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	3,930,414,795
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,518,037,278
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,518,037,278
中間剰余金又は中間欠損金()	18,151,033,797

[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27年6月16日 至 平成27年12月15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27年12月15日現在
1. 1 期首元本額	31,498,264,108円
期中追加設定元本額	8,060,364,641円
期中一部解約元本額	3,144,223,417円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	36,414,405,332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27年6月16日 至 平成27年12月15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	135,182,855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27年12月15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27年12月15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27年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4985円 (14,985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27年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		1,246,949,125
コール・ローン		72,200,639
投資証券		53,432,748,914
派生商品評価勘定		179
未収入金		23,439,864
未収配当金		59,140,774
流動資産合計		54,834,479,495
資産合計		54,834,479,495
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		3,564
未払金		234,026,521
流動負債合計		234,030,085
負債合計		234,030,085
純資産の部		
元本等		
元本	1	36,304,372,781
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		18,296,076,629
元本等合計		54,600,449,410
純資産合計		54,600,449,410
負債純資産合計		54,834,479,495

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27年6月16日 至 平成27年12月15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。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
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

	<p>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取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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 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>
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>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>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成27年12月15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27年6月16日 31,691,905,173円 4,675,266,403円 62,798,795円 36,094,642,214円 164,024,471円 45,706,096円 36,304,372,781円
2. 期末日における受益権の総数	36,304,372,781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27年12月15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27年12月15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				
売 建	3,290,912	-	3,290,733	179
イギリス・ポンド	3,290,912	-	3,290,733	179
買 建	3,290,912	-	3,287,348	3,564
アメリカ・ドル	3,290,912	-	3,287,348	3,564
合計	6,581,824	-	6,578,081	3,385

（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27年12月15日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.5040円 (15,040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27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,532,096,721
投資信託受益証券		38,619,849,575
親投資信託受益証券		323,366,984
流動資産合計		40,475,313,280
資産合計		40,475,313,280
負債の部		
流動負債		
未払解約金		819,992,074
未払受託者報酬		8,748,939
未払委託者報酬		65,617,393
その他未払費用		1,078,765
流動負債合計		895,437,171
負債合計		895,437,171
純資産の部		
元本等		
元本	1	90,509,060,053
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2	50,929,183,944
（分配準備積立金）		908,436,079
元本等合計		39,579,876,109
純資産合計		39,579,876,109
負債純資産合計		40,475,313,280

[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27年6月16日 至 平成27年12月15日 金額(円)
営業収益	
受取利息	244,246
有価証券売買等損益	11,294,660,033
為替差損益	779,350,996
営業収益合計	12,073,766,783
営業費用	
受託者報酬	8,748,939
委託者報酬	65,617,393
その他費用	1,331,884
営業費用合計	75,698,216
営業損失()	12,149,464,999
経常損失()	12,149,464,999
中間純損失()	12,149,464,999
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	722,046,015
期首剰余金又は期首欠損金()	28,206,275,545
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,706,581,518
中間一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	3,706,581,518
剰余金減少額又は欠損金増加額	15,002,070,933
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	15,002,070,933
中間剰余金又は中間欠損金()	50,929,183,944

[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27年6月16日 至 平成27年12月15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</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。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</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>

(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27年12月15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	68,769,255,848円 30,469,163,138円 8,729,358,933円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	90,509,060,053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50,929,183,944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27年6月16日 至 平成27年12月15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27年12月15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27年12月15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27年12月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.4373円 (4,373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27年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		33,017,042,422
国債証券		40,089,857,001
未収利息		1,210,873
前払費用		550,221
流動資産合計		73,108,660,517
資産合計		73,108,660,517
負債の部		
流動負債		
未払解約金		5,000,072,000
流動負債合計		5,000,072,000
負債合計		5,000,072,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	66,787,467,006
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,321,121,511
元本等合計		68,108,588,517
純資産合計		68,108,588,517
負債純資産合計		73,108,660,517

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27年6月16日 至 平成27年12月15日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成27年12月15日現在
1. 1 期首	平成27年6月16日
期首元本額	28,469,546,869円
期中追加設定元本額	119,349,509,779円
期中一部解約元本額	81,031,589,642円
期末元本額の内訳	

ファンド名

深センA株資金拠出用ファンド (適格機関投資家専用)	1,000,294,205円
ダイワ/“RICI®”コモ ディティ・ファンド	8,952,508円
US債券NB戦略ファンド(為 替ヘッジあり/年1回決算型)	740,564円
US債券NB戦略ファンド(為 替ヘッジなし/年1回決算型)	1,623,350円
スマート・アロケーション・D ガード	161,095,201円
NBストラテジック・インカ ム・ファンド<ラップ>米ドル コース	981円
NBストラテジック・インカ ム・ファンド<ラップ>円コー ス	981円
NBストラテジック・インカ ム・ファンド<ラップ>世界通 貨分散コース	981円
ダイワファンドラップ コモ ディティセレクト	317,088,630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/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
(適格機関投資家専用)スマー ト・シックス・Dガード	1,909,290,604円
ブルベア・マネー・ポートフォ リオ	18,619,521,080円
ブル3倍日本株ポートフォリオ	41,669,070,298円
ベア2倍日本株ポートフォリオ	2,324,453,419円
ダイワFEグローバル・バ リュ株ファンド(ダイワSMA 専用)	13,896,435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/アムンディ食糧増産関 連ファンド	14,780,160円
ダイワ日本リート・ファンド・ マネー・ポートフォリオ	51,816,622円
ダイワ新興国ハイインカム・プ ラス - 金積立型 -	1,972,537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	4,926,716円
ダイワ新興国ソブリン債券ファ ンド(資産成長コース)	49,082,149円
ダイワ新興国ソブリン債券ファ ンド(通貨 コース)	196,290,094円
ダイワ・ダブルバランス・ファ ンド(Dガード付/部分為替 ヘッジあり)	163,058,338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MLPファンド(毎 月分配型)米ドルコース	13,732,222円
ダイワ米国MLPファンド(毎 月分配型)日本円コース	3,874,449円
ダイワ米国MLPファンド(毎 月分配型)通貨 コース	13,437,960円
ダイワ英国高配当株ツイン (毎月分配型)	98,107円
ダイワ英国高配当株ファンド	98,107円
ダイワ英国高配当株ファンド・ マネー・ポートフォリオ	7,567,671円
DCスマート・アロケーショ ン・Dガード	3,756,906円
ダイワ・世界コモディティ・ ファンド(ダイワSMA専用)	490,418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
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	66,787,467,006円
2. 期末日における受益権の総数	66,787,467,006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27年12月15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27年12月15日現在
該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成27年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.0198円
(1万口当たり純資産額)	(10,198円)

[次へ](#)

「Daiwa “ RICI ” Fund」の状況

以下に記載した同ファンドの情報は、会計監査人により監査を受けた財務諸表を委託会社で抜粋・翻訳したものであります。

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

2015年4月30日に終了した会計年度

運用、管理

受託会社

G.A.S. (Cayman) Limited
c/o Avalon Trust & Corporate Services Ltd
Landmark Square
1st Floor, 64 Earth Close
P.O. Box 715
Grand Cayman KY1-1107
Cayman Islands

運用会社

Daiwa Asset Management Services Ltd. (Cayman)
P.O. Box 309
Ugland House
Grand Cayman KY1-1104
Cayman Islands

日本における運用会社の代理人

Daiwa Asset Management Co. Ltd.
〒100-6753
東京都千代田区
丸の内1丁目9-1

投資運用会社

Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.

3 Phillip Street
#16-04, Royal Group Building
Singapore 048693

事務管理代行会社**SMT Fund Services (Ireland) Limited**

Block 5
Harcourt Centre
Harcourt Road
Dublin 2
Ireland

運用、管理

（ 続き ）

資産保管会社**SMT Trustees (Ireland) Limited**

Block 5
Harcourt Centre
Harcourt Road
Dublin 2
Ireland

独立監査人**PricewaterhouseCoopers**

P.O. Box 258 GT
Strathvale House
North Church Street
George Town
Grand Cayman KY1-1104
Cayman Islands

法律顧問**ケイマン諸島法：****Maples and Calder**

Level 53, The Center
99 Queens Road Central
Hong Kong

日本法：

森・濱田松本法律事務所

〒100-8222

東京都千代田区丸の内2丁目6-1

丸の内パークビル

投資運用会社の報告書
2015年4月30日に終了した会計年度**はじめに**

本ファンドの一口当たり純資産価額は、2014年4月30日の100.261米ドルから減少して2015年4月30日に73.038米ドルになりました。同期間に、RICI[®]（ロジャーズ国際コモディティ指数[®]）は、3,751.73から2,745.22に下落しました。本ファンドの純資産価額は27.15%減少しましたが、一方RICI[®]は26.83%下落しました。

商品市場

エネルギーの下落によってすべてのセクターが下落したため、RICI[®]指数は同期間に下落しました。米国経済は徐々に勢いを増しドル高となり、ドル建てのすべてのコモディティが圧力を受けました。一方、欧州と中国の経済成長率は失速し、エネルギーや産業金属の需要の重しとなりました。市場の過剰供給のためエネルギーは急落しました。農業セクターも米国の好天と世界的に豊富な農産物の供給を背景に下落しました。

エネルギーセクターは同期間にアンダーパフォームし下落しました。世界的に景気回復が緩慢な中、需要が市場の過剰供給に追いつきませんでした。米国の経済成長の回復を受け、エネルギーは5、6月に上昇しましたが、世界的に製造業の活動が減速した7月から下落しました。一方、OPEC（石油輸出機構）加盟国は米国のシェールオイルに対して自国のシェアを守るために原油価格を引き下げ、供給過剰を緩和するために産出目標を減少させる意思がないことを示しました。IMF（国際通貨基金）による世界経済見通しの下方修正を受け、エネルギーは12月にさらに下落しました。米国の在庫が増加し市場で供給過剰な状況が長引いたことでエネルギーセクターはさらに下落しました。3月にFRB（米連邦準備制度理事会）は利上げ見通しを後退させ、ドルは下落しました。米国のリグ稼働数の減少と生産減速で市場の供給過剰が緩和する可能性から、4月にエネルギーは下落分の一部を取り戻しました。

今年度の金属製品価格は、中国や欧州の景気拡大が市場コンセンサスを下回ったことから需要後退が懸念されたため、急落しました。その一方で、米国景気は改善しました。ドル高によってオルタナティブ投資としての貴金属需要が後退しました。10月にFRBが好調な景気拡大を考慮して月次の債券購入プログラムを終了するとドルは上昇し、貴金属のインフレヘッジとしての魅力は減退しました。1月に、ギリシャのユーロ圏からの脱退をめぐる懸念が高まり、スイスが自国通貨のユーロとの連動停止を決定すると、貴金属の需要は増加しました。しかし、このような懸念は急速に後退し金価格は下落しました。中国の旧正月における金の現物需要減少も貴金属価格下落の要因となりました。中国政府が景気刺激に動いたことで、2月から銅価格は急上昇しました。米国の住宅セクターの好調なパフォーマンスも銅価格を押し上げました。

2015年4月30日で終了する年度の農産物セクターは下落しました。農産物の価格は、気象条件が全般的に良好だったことにより収穫量見通しが押し上げられ、年度始めから下落しました。降雨によって中西部の一部で農産物の収穫が遅れ、国内需要が増加したため、大豆とトウモロコシの価格は10月から急騰しました。米国とロシアが悪天候となったことも小麦価格を下支えしました。しかし、ドル高と輸出版売の減少により農産物の価格は1月から下落しました。

Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.

2015年6月19日

財政状態計算書

2015年4月30日現在

	注記	2015年 米ドル	2014年 米ドル
資産			
現金	5	8,248,047	5,075,923
証拠金	5	93,937,580	51,964,042
受取勘定	6	253	161
損益通算公正価値金融資産	2,3,4	216,419,743	129,904,482
資産合計		318,605,623	186,944,608
資本			
受益証券元本		353,078,740	164,847,473
剰余金		(43,613,890)	19,751,986
資本合計	8,14	309,464,850	184,599,459
負債			
未払証拠金	5	81,121	216,204
支払勘定 - 1年以内に支払期限が到来するもの	7	275,825	186,936
損益通算公正価値金融負債	2,3,4	8,783,827	1,942,009
負債合計		9,140,773	2,345,149
資本および負債合計		318,605,623	186,944,608

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。

日付：2015年10月16日

包括利益計算書

2015年4月30日に終了した会計年度

	注記	2015年 米ドル	2014年 米ドル
収入			
利息収入		2,969	2,139

損益通算公正価値金融資産および負債による純利益/(損失)	11	(60,774,369)	8,621,402
純投資利益/(損失)合計		(60,771,400)	8,623,541
費用			
運用会社報酬	9	1,815,063	1,206,869
管理報酬	9	329,971	219,474
受託会社報酬	9	22,880	14,628
資産保管報酬	9	32,107	21,941
仲介手数料		352,816	248,244
監査費用		22,832	29,959
その他の費用		8,768	8,785
費用合計		2,584,437	1,749,900
当会計年度の営業利益/(損失)		(63,355,837)	6,873,641
金融費用			
支払利息		(10,039)	(8,674)
金融費用合計		(10,039)	(8,674)
包括利益合計		(63,365,876)	6,864,967

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

2015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
2013年5月1日現在	94,586,670	12,887,019	107,473,689
包括利益合計	-	6,864,967	6,864,967
買戻償還可能参加型受益証券の発行収入	73,449,999	-	73,449,999
買戻償還可能参加型受益証券の買戻支出	(3,189,196)	-	(3,189,196)
2014年4月30日現在	164,847,473	19,751,986	184,599,459
2014年5月1日現在	164,847,473	19,751,986	184,599,459

包括利益合計	-	(63,365,876)	(63,365,876)
買戻償還可能参加型受益証券の発行収入	188,970,000	-	188,970,000
買戻償還可能参加型受益証券の買戻支出	(738,733)	-	(738,733)
2015年4月30日現在	<u>353,078,740</u>	<u>(43,613,890)</u>	<u>309,464,850</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。

財務諸表の注記

2015年4月30日

1. 概要

ダイワ“RICI”ファンド(以下、「本信託」)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、2006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。

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。

損益通算公正価値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

2015年4月30日

(続き)

2. 重要な会計方針 (続き)

損益通算公正価値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。2015年4月30日現在および2014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、投資明細表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、その価値の変動を評価益として認識しています。先物契約のカウンターパーティーはNewedge USA, LLCとUBS Limited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」）である米ドルで測定されます。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、財務報告基準（以下、「FRS」）第3号「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、FRS第1号「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おりません。

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（以下、「サブ・カストディアン」という）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とUBS Limitedに差し入れた/支払うべき現金です。

財務諸表の注記

2015年4月30日

(続き)

2. 重要な会計方針 (続き)

買戻償還可能参加型受益証券

本信託は、受益証券保有者の選択で買戻請求をすることができる買戻償還可能参加型受益証券を発行しており、FRS第25号(改訂)にしたがって資本に分類されています。FRS第25号(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額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)

2015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
損益通算公正価値金融資産				
売買目的保有：				
-債券	-	201,454,855	-	201,454,855
-先物契約	14,964,888	-	-	14,964,888
	<u>14,964,888</u>	<u>201,454,855</u>	<u>-</u>	<u>216,419,743</u>
損益通算公正価値金融負債				
売買目的保有：				
-先物契約	8,783,827	-	-	8,783,827

8,783,827	-	-	8,783,827
-----------	---	---	-----------

財務諸表の注記

2015年4月30日

(続き)

3. 金融商品の公正価値(続き)

2014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
損益通算公正価値金融資産				
売買目的保有：				
-債券	-	126,479,624	-	126,479,624
-先物契約	3,424,858	-	-	3,424,858
	3,424,858	126,479,624	-	129,904,482
損益通算公正価値金融負債				
売買目的保有：				
-先物契約	1,942,009	-	-	1,942,009
	1,942,009	-	-	1,942,009

当年度においてレベル間の移動はありませんでした(2014年：なし)。

4. 財務リスク管理

	2015年 米ドル	2014年 米ドル
損益通算公正価値金融資産		
売買目的保有：		
-債券	201,454,855	126,479,624
-先物契約	14,964,888	3,424,858
	216,419,743	129,904,482
損益通算公正価値金融負債		
売買目的保有：		
-先物契約	8,783,827	1,942,009

損益通算公正価値金融負債合計

8,783,827

1,942,009

財務諸表の注記

2015年4月30日

(続き)

4. 財務リスク管理（続き）

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。

市場価格リスク

保有する金融投資の将来の価格に関する不確実性から市場価格リスクが生じます。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%以上を米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35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。

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。

	2015年	2014年
RICI指数	2,745.22	3,751.73
1受益証券当たりの純資産価額	73.038米ドル	100.261米ドル

RICIが-1.26%変動すれば（2014年：9.76%）、本信託の純資産価額は-2.76%、（8,528,433）米ドル変動し（2014年：8.21%、15,158,400米ドル）、RICIが1.26%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（2014年：-9.76%）。

財務諸表の注記

2015年4月30日

（ 続き ）

4. 財務リスク管理（ 続き ）

市場価格リスク（ 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2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、純資産価額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純資産価額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。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。

財務諸表の注記

2015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）

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。

2015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	81,121	-	-	81,121
支払勘定 - 1年以内に 支払期限が到来するもの	-	275,825	-	275,825
損益通算公正価値金融負債	3,645,398	4,638,310	500,119	8,783,827
金融負債合計	3,726,519	4,914,135	500,119	9,140,773
2014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	216,204	-	-	216,204
支払勘定 - 1年以内に 支払期限が到来するもの	-	186,936	-	186,936
損益通算公正価値金融負債	1,014,001	855,207	72,801	1,942,009
金融負債合計	1,230,205	1,042,143	72,801	2,345,149

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。2015年4月30日の時点で、93,856,459米ドル（Newedge USA, LLCに73,867,064米ドル、UBS Limited に19,989,395米ドル）（2014年：Newedge USA, LLCに51,747,838米ドル）の証拠金（純額）および公正価値（6,181,060）米ドル（2014年：（1,482,849）米ドル）の売買目的有価証券がNewedge USA, LLCとUBS Limited（2014年：Newedge USA, LLC）に保有されています。8,248,047米ドルの現金（2014年は5,075,923米ドル）と時価総額201,454,855米ドルの売買目的有価証券（2014年は126,479,624米ドル）はBBHが保管していました。BBHの信用格付けはA+（フィッチ）（2014年：A+（フィッチ））、Newedge USA, LLCはA/A（フィッチ）（2014年：A/A（フィッチ））、UBS LimitedはA（フィッチ）です。

財務諸表の注記

2015年4月30日

（続き）

4. 財務リスク管理（続き）

信用リスク（続き）

信用リスクは、カウンターパーティー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。資産保管会社であるNewedge USA, LLCまたはUBS Limited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(ムーディーズ/S&P)です(2014年:A1/P1(ムーディーズ/S&P))。

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カウンターパーティー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、米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額を算定しています。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エクスポージャーは以下の通りです。

	2015年 米ドル	2014年 米ドル
ユーロ	(199,333)	224,824
日本円	(90,910)	(214,647)
英国ポンド	198,798	(6,197)
合計	(91,445)	3,980

仮に、2015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1,993米ドル増加していました(2014年は2,248米ドルの減少)。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、2015年4月30日時点で米ドルの対日本円為替レートが1%低くなっていた場合、純資産は909米ドル増加していました(2014年は2,146米ドルの増加)。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。

財務諸表の注記

2015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、2015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1,988米ドル減少していました(2014年は62米ドルの増加)。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、高格付けの米ドル建て短期金融資産(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、満期1年未満の米ドル短期債券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ています。

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。2015年4月30日現在および2014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%(2014年は0.25%)上昇すると、当会計年度の公正価値に基づく債券の公正価値は503,637米ドル減少します(2014年は316,199米ドル)。一方、金利が0.25%(2014年は0.25%)低下し、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%(2014年は0.25%)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

2015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、2015年4月30日現在および2014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
2015年					
資産					
現金	8,248,047	-	-	-	8,248,047
証拠金	93,937,580	-	-	-	93,937,580
未収利息	-	-	-	253	253
損益通算公正価値 金融資産	36,498,930	56,992,069	107,963,856	14,964,888	216,419,743
資産合計	138,684,557	56,992,069	107,963,856	14,965,141	318,605,623
負債					
未払証拠金	81,121	-	-	-	81,121
支払手数料引当金	-	-	-	275,825	275,825
損益通算公正価値 金融負債	-	-	-	8,783,827	8,783,827

負債合計	81,121	-	-	9,059,652	9,140,773
利息感応度差異合計	138,603,436	56,992,069	107,963,856	N/A	N/A
2014年					
資産					
現金	5,075,923	-	-	-	5,075,923
証拠金	51,964,042	-	-	-	51,964,042
未収利息	-	-	-	161	161
損益通算公正価値 金融資産	12,998,989	67,491,821	45,988,814	3,424,858	129,904,482
資産合計	70,038,954	67,491,821	45,988,814	3,425,019	186,944,608
負債					
未払証拠金	216,204	-	-	-	216,204
支払手数料引当金	-	-	-	186,936	186,936
損益通算公正価値 金融負債	-	-	-	1,942,009	1,942,009
負債合計	216,204	-	-	2,128,945	2,345,149
利息感応度差異合計	69,822,750	67,491,821	45,988,814	N/A	N/A

財務諸表の注記

2015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。

金融商品の相殺

認識された額を相殺するための強制力のある法的権限を現時点で有し、資産の実現と負債の清算を同時に行う意図がある場合に限り、金融資産と金融負債は相殺され、財政状態計算書に純額表示されます。これは一般にマスターネットティング契約には適用されず、関連する資産と負債は財政状態計算書にグロススペースで表示されます。

2015年および2014年の4月30日時点で本信託はいかなるマスターネットティング契約の影響も受けていません。

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とUBS Limitedに差し入れた/支払うべき現金です。

ネットの証拠金93,856,459米ドル(2014年は51,747,838米ドル)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

	2015年 米ドル	2014年 米ドル
未収利息	253	161
	<u>253</u>	<u>161</u>

財務諸表の注記 2015年4月30日 (続き)

7. 支払勘定 - 1年以内に支払期限が到来するもの

	注記	2015年 米ドル	2014年 米ドル
支払手数料引当金	9	275,825	186,936
		<u>275,825</u>	<u>186,936</u>

8. 発行済みおよび買戻償還済み買戻償還可能参加型受益証券

	2015年	2014年
米ドル建て買戻償還可能参加型受益証券		
期首の発行済み買戻償還可能参加型受益証券数	1,841,192	1,110,485
買戻償還可能参加型受益証券の発行数	2,403,919	763,507
買戻償還可能参加型受益証券の買戻償還数	(8,100)	(32,800)
期末の発行済み買戻償還可能参加型受益証券数	<u>4,237,011</u>	<u>1,841,192</u>

本信託は、買戻償還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償還することが可能であり、資本として分類されます。買戻償還可能参加型受益証券は、本信託の純資産価額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。

買戻償還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額に基づいた価格で、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額は、買戻償還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(2014年:100%)。

買戻償還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純資産価額の年率0.01%を月間報酬として受け取ります。これは各評価日の時点で発生し計算され、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額の年率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。

財務諸表の注記

2015年4月30日

(続き)

9. 手数料および費用 (続き)

運用会社は、投資運用会社の手数料として純資産価額の年率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、純資産価額の年率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、純資産価額の年率0.02%を保持します。

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額の年率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額の年率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・カストディアンは、証券取引1件毎に10米ドル、現金取引1件毎に15米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・カスト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米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。

	2015年 米ドル	2014年 米ドル
運用会社報酬	199,445	123,893
管理報酬	36,263	22,567
受託会社報酬	2,410	1,501
資産保管報酬	3,615	2,250
監査費用	24,121	28,351
その他の費用	9,971	8,374
	275,825	186,936

財務諸表の注記

2015年4月30日

（ 続 き ）

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。通常の業務を除き、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、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。投資家も関連当事者とみなされます。当年度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。

11. 損益通算公正価値金融資産および負債による純利益/（損失）

	2015年 米ドル	2014年 米ドル
純実現利益/（損失）：		
-先物契約	(65,611,910)	4,742,530
-証券および通貨への投資	45,390	47,679
	(65,566,520)	4,790,209
純評価益の変動：		
-先物契約	4,698,211	3,788,514
-証券および通貨への投資	5,905	(21,161)
	4,704,116	3,767,353

取得ディスカウントの償却	88,035	63,840
損益通算公正価値金融資産および負債による純利益/(損失)	<u>(60,774,369)</u>	<u>8,621,402</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。

財務諸表の注記

2015年4月30日

(続き)

14. 純資産価額の推移

	2015年	2014年
純資産価額	309,464,850米ドル	184,599,459米ドル
受益証券数	4,237,011	1,841,192
1受益証券当たりの純資産価額	73.038米ドル	100.261米ドル

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。

	2015年	2014年
オーストラリア・ドル	-	1.079270
カナダ・ドル	-	1.097450
ユーロ	0.892420	0.721210
日本円	119.670000	102.150000
英国ポンド	0.650720	0.592220

16. 後発事象

2015年4月30日以降2015年10月16日までの本信託の購入額は79,900,000米ドルで、買戻額は965,264米ドルでした。

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。

投資明細表

2015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 (%)
米国			
US T-Bill 0% YLD 07-May-2015	16,500,000	16,499,889	5.33
US T-Bill 0% YLD 28-May-2015	20,000,000	19,999,041	6.46
US T-Bill 0% YLD 11-Jun-2015	20,000,000	19,997,950	6.46
US T-Bill 0% YLD 09-Jul-2015	19,000,000	18,996,941	6.14
US T-Bill 0% YLD 23-Jul-2015	18,000,000	17,997,178	5.82
US T-Bill 0% YLD 6-Aug-2015	19,500,000	19,496,507	6.30
US T-Bill 0% YLD 20-Aug-2015	21,000,000	20,996,083	6.78
US T-Bill 0% YLD 3-Sep-2015	22,000,000	21,993,489	7.11
US T-Bill 0% YLD 15-Oct-2015	22,000,000	21,988,177	7.11
US T-Bill 0% YLD 12-Nov-2015	23,500,000	23,489,600	7.59
債券合計		201,454,855	65.10

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。

投資明細表
2015年4月30日
(続き)

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 (EOP) Sep-2015	309	3,272,002	-	(220,678)
Rapeseed (EOP) Aug-2015	156	3,131,653	-	(127,182)
		6,403,655	-	(347,860)
日本				
Rubber (RCM) Oct-2015	332	3,042,095	-	(9,789)
		3,042,095	-	(9,789)
英国				
Brent Crude Oil (ICE) - Jun-2015	224	13,127,880	1,830,840	-
Brent Crude Oil (ICE) - Jul-2015	412	27,606,490	182,910	-

Coffee Robusta (LIF) - Jul-2015	342	6,042,440	86,200	-
Copper Grade A (LME) - May-2015	79	11,667,450	874,788	-
Copper Grade A (LME) - May-2015	(79)	(11,987,975)	-	(554,263)
Copper Grade A (LME) - Jun-2015	77	11,673,088	545,850	-
Copper Grade A (LME) - Jun-2015	(51)	(7,965,013)	-	(128,050)
Copper Grade A (LME) - Jul-2015	54	8,430,413	131,288	-
Gas Oil (ICE) - Jun-2015	22	1,178,425	139,925	-
Gas Oil (ICE) - Jul-2015	42	2,512,650	9,450	-
No. 7 Cocoa (LIF) - Jul-2015	102	3,003,949	138,877	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2015	254	11,455,131	700,356	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2015	(254)	(11,306,663)	-	(848,825)
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2015	262	11,698,144	895,869	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2015	(173)	(8,219,094)	-	(96,800)
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jul-2015	176	8,391,350	96,250	-
Primary Nickel (LME) - May-2015	33	2,790,009	-	(34,245)
Primary Nickel (LME) - May-2015	(33)	(2,501,235)	-	(254,529)
Primary Nickel (LME) - Jun-2015	37	2,808,345	285,003	-
Primary Nickel (LME) - Jun-2015	(25)	(2,049,072)	-	(41,028)
Primary Nickel (LME) - Jul-2015	26	2,138,100	37,944	-
Special High Grade Zinc (LME) - May-2015	111	5,717,850	814,500	-
Special High Grade Zinc (LME) - May-2015	(111)	(5,811,556)	-	(720,793)
Special High Grade Zinc (LME) - Jun-2015	112	5,886,381	711,819	-
Special High Grade Zinc (LME) - Jun-2015	(74)	(4,312,025)	-	(47,500)
Special High Grade Zinc (LME) - Jul-2015	72	4,188,900	42,000	-
Standard Lead (LME) - May-2015	(130)	(5,958,538)	-	(933,088)
Standard Lead (LME) - May-2015	130	5,688,394	1,203,231	-

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。

投資明細表
2015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)				
Standard Lead (LME) - Jun-2015	128	5,883,738	901,863	-
Standard Lead (LME) - Jun-2015	(85)	(4,479,188)	-	(26,875)

Standard Lead (LME) - Jul-2015	80	4,207,088	22,913	-
Tin (LME) - May-2015	31	2,780,275	-	(299,655)
Tin (LME) - May-2015	(31)	(2,591,220)	110,600	-
Tin (LME) - Jun-2015	34	2,837,165	-	(113,765)
Tin (LME) - Jun-2015	(23)	(1,827,395)	-	(14,905)
Tin (LME) - Jul-2015	26	2,067,000	16,380	-
White Sugar (LIF) - Aug-2015	166	2,931,340	195,270	-
		97,703,021	9,974,126	(4,114,321)
米国				
Corn (CBT) - Jul-2015	774	15,070,688	-	(896,813)
Cotton No. 2 (NYB) - Jul-2015	392	12,407,750	896,730	-
Frozen Concentrated Orange Juice (NYB) - Jul-2015	100	1,874,453	-	(144,953)
Gasoline RBOB FUT (NYM) - Jun-2015	40	3,069,814	365,954	-
Gasoline RBOB FUT (NYM) - Jul-2015	75	6,346,028	46,267	-
Gold (CMX) - Jun-2015	41	4,928,100	-	(80,260)
Gold (CMX) - Aug-2015	85	10,176,100	-	(117,200)
Heating Oil (NYM) - Jun-2015	24	1,778,881	217,463	-
Heating Oil (NYM) - Jul-2015	46	3,810,387	26,758	-
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jun-2015	184	4,895,550	166,290	-
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jul-2015	399	10,896,840	283,140	-
Lean Hogs (CME) - Jun-2015	33	1,044,860	29,950	-
Lean Hogs (CME) - Aug-2015	64	2,112,770	-	(3,970)
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Jun-2015	313	16,368,300	2,295,890	-
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Jul-2015	566	34,126,410	235,450	-
Live Cattle (CME) - Jun-2015	32	1,885,080	31,080	-
Live Cattle (CME) - Aug-2015	70	4,164,700	-	(17,900)
Lumber (CME) - Jul-2015	108	3,229,303	-	(214,159)
Milk Future (CME) - May-2015	3	93,640	3,680	-
Milk Future (CME) - Jun-2015	6	196,020	60	-
Oat (CBT) - Jul-2015	122	1,608,625	-	(118,700)
Palladium (NYM) - Jun-2015	4	313,895	-	(3,294)
Palladium (NYM) - Sep-2015	8	625,400	-	(3,400)
Platinum (NYM) - Jul-2015	95	5,605,670	-	(188,770)
Rough RICE (CBT) - Jul-2015	109	2,410,880	-	(166,570)

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。

投資明細表
2015年4月30日
(続き)

想定元本 評価益 評価(損)

先物契約(続き)	数量	米ドル	米ドル	米ドル
米国(続き)				
Silver (CMX) - Jul-2015	146	12,250,910	-	(459,220)
Soybean Meal (CBT) - Jul-2015	72	2,342,030	-	(66,110)
Soybean Oil (CBT) - Jul-2015	327	6,037,704	172,026	-
Soybeans (CBT) - Jul-2015	219	10,742,713	-	(55,513)
Sugar No. 11 World (NYB) - Jul-2015	212	2,909,435	220,024	-
Wheat (CBT) - Jul-2015	596	15,514,350	-	(1,389,150)
Wheat (CBT) - Jul-2015	118	3,329,975	-	(385,875)
		202,167,261	4,990,762	(4,311,857)
先物契約合計		309,316,032	14,964,888	(8,783,827)

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。

投資明細表 2014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 (%)
米国			
US T-Bill 0% YLD 29-May-2014	13,000,000	12,998,989	7.04
US T-Bill 0% YLD 19-Jun-2014	20,000,000	19,997,686	10.83
US T-Bill 0% YLD 10-Jul-2014	22,500,000	22,497,239	12.19
US T-Bill 0% YLD 24-Jul-2014	25,000,000	24,996,896	13.54
US T-Bill 0% YLD 14-Aug-2014	16,000,000	15,996,500	8.67
US T-Bill 0% YLD 11-Sep-2014	16,000,000	15,995,567	8.67
US T-Bill 0% YLD 16-Oct-2014	14,000,000	13,996,747	7.58
債券投資合計		126,479,624	68.52

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。

投資明細表 2014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
フランス				
Milling Wheat (EOP) - Nov-2014	130	1,819,460	32,636	-
Rapeseed (EOP) - Aug-2014	73	1,884,143	-	(45,756)
		3,703,603	32,636	(45,756)
日本				
Rubber (TCM) - Oct-2014	168	1,688,311	1,557	-
		1,688,311	1,557	-
英国				
Brent Crude Oil (ICE) - Jun-2014	74	7,819,350	177,830	-
Brent Crude Oil (ICE) - Jul-2014	149	16,089,310	-	(67,340)
Coffee Robusta (LIF) - Jul-2014	175	3,620,410	173,590	-
Copper Grade A (LME) - May-2014	40	7,008,575	-	(346,075)
Copper Grade A (LME) - May-2014	(40)	(6,669,775)	7,275	-
Copper Grade A (LME) - Jun-2014	44	7,330,200	-	(10,800)
Copper Grade A (LME) - Jun-2014	(29)	(4,849,700)	25,550	-
Copper Grade A (LME) - Jul-2014	29	4,845,725	-	(27,375)
Gas Oil (ICE) - Jun-2014	8	715,400	5,400	-
Gas Oil (ICE) - Jul-2014	16	1,450,400	-	(12,000)
No. 7 Cocoa (LIF) - Jul-2014	60	1,892,422	-	(20,145)
Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2014	160	6,974,713	92,288	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2014	(160)	(7,050,806)	-	(16,193)
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2014	168	7,459,769	21,481	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2014	(112)	(5,007,800)	20,300	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jul-2014	108	4,863,025	-	(18,550)
Primary Nickel (LME) - May-2014	21	1,848,717	458,847	-
Primary Nickel (LME) - May-2014	(21)	(1,999,494)	-	(308,070)
Primary Nickel (LME) - Jun-2014	19	1,810,224	277,914	-
Primary Nickel (LME) - Jun-2014	(13)	(1,422,426)	-	(6,300)
Primary Nickel (LME) - Jul-2014	11	1,203,414	6,300	-
Special High Grade Zinc (LME) - May-2014	69	3,576,419	-	(53,969)
Special High Grade Zinc (LME) - May-2014	(69)	(3,395,231)	-	(127,218)
Special High Grade Zinc (LME) - Jun-2014	74	3,654,619	124,931	-
Special High Grade Zinc (LME) - Jun-2014	(49)	(2,510,175)	7,500	-
Special High Grade Zinc (LME) - Jul-2014	48	2,460,600	-	(8,400)

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。

投資明細表
2014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)				
Standard Lead (LME) - May-2014	66	3,513,825	-	(66,563)
Standard Lead (LME) - May-2014	(66)	(3,387,175)	-	(60,088)
Standard Lead (LME) - Jun-2014	(47)	(2,470,056)	2,850	-
Standard Lead (LME) - Jun-2014	71	3,657,463	69,594	-
Standard Lead (LME) - Jul-2014	46	2,425,063	-	(2,588)
Tin (LME) - May-2014	15	1,753,125	-	(29,700)
Tin (LME) - May-2014	(15)	(1,717,300)	-	(6,125)
Tin (LME) - Jun-2014	16	1,830,990	6,130	-
Tin (LME) - Jun-2014	(11)	(1,269,295)	6,275	-
Tin (LME) - Jul-2014	10	1,154,050	-	(6,200)
White Sugar (LIF) - Aug-2014	77	1,858,130	-	(22,065)
		59,066,705	1,484,055	(1,215,764)
米国				
Corn (CBT) - Jul-2014	346	8,742,188	236,513	-
Cotton No. 2 (NYB) - Jul-2014	168	7,830,525	89,835	-
Frozen Concentrated Orange Juice (NYB) - Jul-2014	47	1,069,073	63,158	-
Gasoline RBOB FUT (NYM) - Jun-2014	15	1,805,849	61,723	-
Gasoline RBOB FUT (NYM) - Jul-2014	30	3,713,661	-	(23,877)
Gold (CMX) - Jun-2014	24	3,218,060	-	(107,900)
Gold (CMX) - Aug-2014	48	6,222,480	-	(1,680)
Heating Oil (NYM) - Jun-2014	9	1,090,958	15,863	-
Heating Oil (NYM) - Jul-2014	18	2,223,131	-	(12,814)
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jun-2014	67	2,897,090	328,960	-
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jul-2014	128	6,205,640	-	(6,600)
Lean Hogs (CME) - Jun-2014	12	543,250	47,750	-
Lean Hogs (CME) - Aug-2014	26	1,269,600	-	(1,320)
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Jun-2014	97	9,617,540	57,240	-
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Jul-2014	198	19,770,300	-	(146,520)
Live Cattle (CME) - Jun-2014	22	1,187,800	19,560	-
Live Cattle (CME) - Aug-2014	45	2,451,330	-	(1,980)
Lumber (CME) - Jul-2014	51	1,909,853	-	(51,821)
Milk Future (CME) - May-2014	1	44,500	600	-
Milk Future (CME) - Jun-2014	3	126,640	680	-
Oat (CBT) - Jul-2014	51	919,925	-	(650)
Palladium (NYM) - Jun-2014	2	140,940	21,560	-

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。

投資明細表
2014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)				
Palladium (NYM) - Sep-2014	5	405,940	785	-
Platinum (NYM) - Jul-2014	47	3,417,065	-	(61,500)
Rough Rice (CBT) - Jul-2014	45	1,408,090	-	(8,140)
Silver (CMX) - Jul-2014	75	7,418,710	-	(228,460)
Soybean Meal (CBT) - Jul-2014	29	1,341,050	90,680	-
Soybean Oil (CBT) - Jul-2014	146	3,593,544	95,292	-
Soybeans (CBT) - Jul-2014	88	6,306,988	349,112	-
Sugar No. 11 World (NYB) - Jul-2014	93	1,872,942	-	(27,227)
Wheat (CBT) - Jul-2014	247	8,603,363	307,162	-
Wheat (KCB) - Jul-2014	47	1,789,238	120,137	-
		119,157,263	1,906,610	(680,489)
先物契約合計		183,615,882	3,424,858	(1,942,009)

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

2015年12月15日現在における当ファンドが組入れている「Daiwa “ RICI ” Fund」の投資有価証券の状況を示しております。

(1) 有価証券

(単位 : USドル)

銘柄名	券面総額	評価額	備考
TREASURY BILL US GOV OPCT 03MAR16	36,000,000	35,988,007.65	
US T-BILL OPCT 26MAY16	34,000,000	33,970,716.34	
USD T-BILL OPCT 14APR16	32,000,000	31,978,082.31	
US T-BILL OPCT 28APR16	30,500,000	30,479,384.29	
US T-BILL OPCT 07JAN16	25,000,000	24,998,750.61	
US T-BILL OPCT 9JUN16	24,000,000	23,939,479.99	
TREASURY BILL US GOV OPCT 04FEB16	23,000,000	22,995,830.50	
US TREASURY BILL OPCT 31MAR16	23,000,000	22,987,430.11	

(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-16	買建	357	-191,127.63	
RAPESEED EURO FUT (EOP) FEB-16	買建	171	41,321.17	
BRENT CRUDE OIL (ICE) FEB-16	買建	982	-6,070,240.00	
COFFEE ROBUSTA (ICE) MAR-16	買建	446	35,750.00	
COPPER GRADE A (LME) DEC-15	買建	114	-1,126,212.50	
COPPER GRADE A (LME) DEC-15	売建	114	1,231,912.50	
COPPER GRADE A (LME) JAN-16	買建	114	-1,164,993.75	
COPPER GRADE A (LME) JAN-16	売建	114	-300,200.00	
COPPER GRADE A (LME) FEB-16	買建	120	328,500.00	
GAS OIL (ICE) FEB-16	買建	96	-620,800.00	
NO 7 COCOA (ICE) MAR-16	買建	101	121,548.22	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-15	買建	367	-682,175.00	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-15	売建	367	-174,181.25	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-16	買建	399	-9,875.00	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-16	売建	399	-106,550.00	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) FEB-16	買建	377	143,418.75	
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-15	買建	60	-536,328.00	
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-15	売建	60	546,420.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-16	買建	58	-520,536.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-16	売建	58	92,205.00	
PRIMARY NICKEL (LME) FEB-16	買建	65	-102,672.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-15	買建	174	-658,818.75	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-15	売建	174	675,700.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-16	買建	171	-645,206.25	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-16	売建	171	60,562.50	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) FEB-16	買建	178	-56,762.50	
STANDARD LEAD (LME) DEC-15	買建	171	241,293.75	
STANDARD LEAD (LME) DEC-15	売建	171	-124,687.50	
STANDARD LEAD (LME) JAN-16	買建	170	114,293.75	
STANDARD LEAD (LME) JAN-16	売建	170	-312,100.00	
STANDARD LEAD (LME) FEB-16	買建	170	318,487.50	
TIN (LME) DEC-15	買建	45	-234,100.00	
TIN (LME) DEC-15	売建	45	85,050.00	
TIN (LME) JAN-16	買建	49	-85,510.00	
TIN (LME) JAN-16	売建	49	124,025.00	
TIN (LME) FEB-16	買建	46	-109,235.00	
WHITE SUGAR (ICE) MAR-16	買建	170	-6,380.00	
RUBBER (TCM) MAY-16	買建	544	64,371.62	
CORN (CBT) MAR-16	買建	889	-576,137.50	
COTTON NO 2 (NYB) MAR-16	買建	452	198,585.00	
FROZEN CONCENTRATED ORANGE JUICE (NYB) MAR-16	買建	96	132,480.00	
GASOLINE RBOB FUT (NYM) FEB-16	買建	184	-266,792.40	
GOLD (CMX) FEB-16	買建	163	-1,009,480.00	
HEATING OIL (NYM) FEB-16	買建	105	-832,314.00	
HENRY HUB NATURAL GAS (NYM) FEB-16	買建	759	-1,632,600.00	

LEAN HOGS (CME) FEB-16	買建	149	-103,430.00	
LIGHT SWEET CRUDE OIL (NYM) FEB-16	買建	1,277	-6,695,750.00	
LIVE CATTLE (CME) FEB-16	買建	128	-879,140.00	
LUMBER (CME) MAR-16	買建	126	229,262.00	
MILK FUTURE (CME) JAN-16	買建	12	-16,100.00	
OAT (CBT) MAR-16	買建	148	38,375.00	
PALLADIUM (NYM) MAR-16	買建	19	-194,370.00	
PLATINUM (NYM) APR-16	買建	148	71,865.00	
ROUGH RICE (CBT) MAR-16	買建	105	-124,420.00	
SILVER (CMX) MAR-16	買建	196	-1,493,860.00	
SOYBEAN MEAL (CBT) MAR-16	買建	90	-116,140.00	
SOYBEAN OIL (CBT) MAR-16	買建	391	309,372.00	
SOYBEANS (CBT) MAR-16	買建	275	-223,662.50	
SUGAR NO 11 WORLD (NYB) MAR-16	買建	205	554,971.20	
WHEAT (CBT) MAR-16	買建	682	-940,125.00	
WHEAT (CBT) MAR-16	買建	147	-157,200.00	

(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27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,257,538,163
投資信託受益証券		102,234,010,003
投資証券		11,257,583,867
流動資産合計		114,749,132,033
資産合計		114,749,132,033
負債の部		
流動負債		
未払解約金		106,819,147
未払受託者報酬		23,150,710
未払委託者報酬		231,507,484
その他未払費用		1,073,483
流動負債合計		362,550,824
負債合計		362,550,824
純資産の部		
元本等		
元本	1	113,100,872,639
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		1,285,708,570
（分配準備積立金）		1,231,078,139
元本等合計		114,386,581,209
純資産合計		114,386,581,209
負債純資産合計		114,749,132,033

[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27年6月16日 至 平成27年12月15日 金額(円)
営業収益	
受取利息	478,665
有価証券売買等損益	698,464,028
営業収益合計	697,985,363
営業費用	
受託者報酬	23,150,710
委託者報酬	231,507,484
その他費用	1,073,483
営業費用合計	255,731,677
営業利益又は営業損失()	953,717,040
経常利益又は経常損失()	953,717,040
中間純利益又は中間純損失()	953,717,040
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()	66,445,593
期首剰余金又は期首欠損金()	1,962,873,550
剰余金増加額又は欠損金減少額	384,599,311
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	384,599,311
剰余金減少額又は欠損金増加額	174,492,844
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	174,492,844
中間剰余金又は中間欠損金()	1,285,708,570

[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27年6月16日 至 平成27年12月15日
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</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(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27年12月15日現在
1. 1期首元本額	94,345,620,378円
期中追加設定元本額	27,433,233,246円
期中一部解約元本額	8,677,980,985円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	113,100,872,639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27年6月16日 至 平成27年12月15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27年12月15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	<p>(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。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p>

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27年12月15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27年12月15日現在

1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0114円 (10,114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27年12月30日

資産総額	252,316,662,389円
負債総額	48,574,914円
純資産総額（ - ）	252,268,087,475円
発行済数量	191,963,223,838口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3141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27年12月30日

資産総額	427,496,018,157円
負債総額	41,501,350円
純資産総額（ - ）	427,454,516,807円
発行済数量	380,608,316,652口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1231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27年12月30日

資産総額	158,916,462,704円
負債総額	70,357,369円
純資産総額（ - ）	158,846,105,335円
発行済数量	133,212,720,934口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1924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27年12月30日

資産総額	125,039,810,621円
負債総額	25,021,798円
純資産総額（ - ）	125,014,788,823円

発行済数量	114,965,399,954口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0874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27年12月30日

資産総額	102,173,717,477円
負債総額	31,895,580円
純資産総額（ - ）	102,141,821,897円
発行済数量	85,385,731,083口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1962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27年12月30日

資産総額	51,362,243,005円
負債総額	10,601,920円
純資産総額（ - ）	51,351,641,085円
発行済数量	40,615,389,904口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2643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27年12月30日

資産総額	70,321,684,941円
負債総額	19,702,898円
純資産総額（ - ）	70,301,982,043円
発行済数量	46,270,247,021口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.5194円

(参考) ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンド

純資産額計算書

平成27年12月30日

資産総額	78,909,684,339円
負債総額	803,380,981円
純資産総額（ - ）	78,106,303,358円
発行済数量	34,947,164,658口

1 単位当たり純資産額（ / ） 2.2350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27年12月30日

資産総額	57,029,345,454円
負債総額	22,161,760円
純資産総額（ - ）	57,007,183,694円
発行済数量	36,629,431,196口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.5563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27年12月30日

資産総額	57,163,558,026円
負債総額	31,511,935円
純資産総額（ - ）	57,132,046,091円
発行済数量	36,553,176,299口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.5630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27年12月30日

資産総額	38,274,522,529円
負債総額	31,834,404円
純資産総額（ - ）	38,242,688,125円
発行済数量	87,730,225,290口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.4359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27年12月30日

資産総額	70,574,816,580円
負債総額	1,000,033,000円
純資産総額（ - ）	69,574,783,580円
発行済数量	68,224,469,360口

1 単位当たり純資産額（ / ）

1.0198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27年12月30日

資産総額	115,134,798,065円
負債総額	23,169,946円
純資産総額（ - ）	115,111,628,119円
発行済数量	113,912,520,315口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.0105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27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年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27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	31	154,128
追加型株式投資信託	603	11,974,562
株式投資信託 合計	634	12,128,690
単位型公社債投資信託	3	29,316
追加型公社債投資信託	17	3,006,014
公社債投資信託 合計	20	3,035,330
総合計	654	15,164,021

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56期事業年度（平成26年4月1日から平成27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57期事業年度に係る中間会計期間（平成27年4月1日から平成27年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 （平成26年3月31日）	当事業年度 （平成27年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	15,186	31,438
有価証券	15,003	4,878
前払費用	157	139
未収委託者報酬	8,265	10,295
未収収益	103	110
繰延税金資産	674	585
その他	15	153
流動資産計	39,406	47,600
固定資産		
有形固定資産	1 252	1 255
建物	23	21

器具備品		228		234
無形固定資産		2,991		2,759
ソフトウェア		2,910		2,758
ソフトウェア仮勘定		68		1
電話加入権		11		-
投資その他の資産		15,077		12,979
投資有価証券		8,338		6,667
関係会社株式		5,141		5,129
出資金		129		124
長期差入保証金		997		996
投資不動産	1	398	1	-
その他		74		60
貸倒引当金		3		-
固定資産計		18,320		15,995
資産合計		57,727		63,596

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	53	64
未払金	8,998	9,172
未払収益分配金	7	5
未払償還金	77	72
未払手数料	4,277	4,965
その他未払金	2	2
未払費用	3,463	4,162
未払法人税等	1,530	1,133
未払消費税等	530	1,429
賞与引当金	955	1,092
その他	1	747
流動負債計	15,534	17,801
固定負債		
退職給付引当金	1,959	2,072
役員退職慰労引当金	80	101
繰延税金負債	1,789	1,745
その他	3	2
固定負債計	3,832	3,920
負債合計	19,366	21,722

純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	10,821	14,126
利益剰余金合計	11,196	14,501
株主資本合計	37,866	41,171
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	494	702
評価・換算差額等合計	494	702
純資産合計	38,360	41,873
負債・純資産合計	57,727	63,596

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	84,771	90,924
その他営業収益	788	933
営業収益計	85,560	91,858
営業費用		
支払手数料	47,520	49,978
広告宣伝費	668	670
調査費	8,246	9,013
調査費	741	867
委託調査費	7,505	8,146
委託計算費	735	756
営業雑経費	1,323	1,289
通信費	249	252
印刷費	477	481
協会費	54	53
諸会費	11	13
その他営業雑経費	531	488
営業費用計	58,494	61,709
一般管理費		

給料	5,708	5,881
役員報酬	243	289
給料・手当	3,785	3,803
賞与	724	695
賞与引当金繰入額	955	1,092
福利厚生費	793	831
交際費	37	45
旅費交通費	191	176
租税公課	222	259
不動産賃借料	1,182	1,180
退職給付費用	373	383
役員退職慰労引当金繰入額	33	38
固定資産減価償却費	963	1,032
諸経費	1,354	1,372
一般管理費計	10,862	11,201
営業利益	16,203	18,948

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	144	1	1,226
受取利息		9		20
その他		220		372
営業外収益計		374		1,620
営業外費用				
投資有価証券売却損		3		84
その他		71		67
営業外費用計		74		152
経常利益		16,503		20,416
特別利益				
固定資産売却益		-		7
特別利益計		-		7
特別損失				
外国税関連費用		-		746
その他		0		26
特別損失計		0		772
税引前当期純利益		16,502		19,651
法人税、住民税及び事業税		6,525		6,238
法人税等調整額		150		17

法人税等合計	6,375	6,220
当期純利益	10,126	13,431

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金	利益剰余金合計	
				繰越利益剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	7,722	8,097	34,767
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,027	△7,027	△7,027
当期純利益	-	-	-	10,126	10,126	10,126
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,099	3,099	3,099
当期末残高	15,174	11,495	374	10,821	11,196	37,866

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	464	464	35,231
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△7,027
当期純利益	-	-	10,126
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	30	30	30
当期変動額合計	30	30	3,129
当期末残高	494	494	38,360

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

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

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. 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

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	8～47年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 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毎に各人別の勤務費用が確定するためであります。

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

(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。

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(貸借対照表)

前事業年度において、「流動資産」に独立掲記しておりました「貯蔵品」、「前払金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「流動資産」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「流動資産」に表示していた「貯蔵品」14百万円、「前払金」0百万円、「その他」0百万円は、「その他」15百万円として組替えております。

前事業年度において、「有形固定資産」に独立掲記しておりました「リース資産」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「有形固定資産」の「器具備品」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「有形固定資産」に表示していた「リース資産」4百万円、「器具備品」224百万円は、「器具備品」228百万円として組替えております。

前事業年度において、「投資その他の資産」に独立掲記しておりました「従業員に対する長期貸付金」、「長期前払費用」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「投資その他の資産」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「投資その他の資産」に表示していた「従業員に対する長期貸付金」68百万円、「長期前払費用」6百万円は、「その他」74百万円として組替えております。

前事業年度において、「流動負債」に独立掲記しておりました「リース債務」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「流動負債」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「流動負債」に表示していた「リース債務」1百万円は、「その他」1百万円として組替えております。

前事業年度において、「固定負債」に独立掲記しておりました「リース債務」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「固定負債」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「固定負債」に表示していた「リース債務」3百万円は、「その他」3百万円として組替えております。

(損益計算書)

前事業年度において、「営業費用」に独立掲記しておりました「公告費」、「受益証券発行費」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業費用」の「その他営業雑経費」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業費用」に表示していた「公告費」0百万円、「受益証券発行費」0百万円、「その他営業雑経費」530百万円は、「その他営業雑経費」531百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「有価証券利息」、「投資有価証券売却益」、「有価証券償還益」、「時効成立分配金・償還金」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「有価証券利息」13百万円、「投資有価証券売却益」64百万円、「有価証券償還益」63百万円、「時効成立分配金・償還金」44百万円、「その他」34百万円は、「その他」220百万円として組替えております。

前事業年度において、「営業外費用」に独立掲記しておりました「有価証券償還損」、「時効成立後支払分配金・償還金」、「投資不動産管理費用」、「貯蔵品廃棄損」は、金額的重要性が乏し

いため、当事業年度より「営業外費用」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」に表示していた「有価証券償還損」18百万円、「時効成立後支払分配金・償還金」16百万円、「投資不動産管理費用」16百万円、「貯蔵品廃棄損」9百万円、「その他」9百万円は、「その他」71百万円として組替えております。

前事業年度において、「特別損失」に独立掲記しておりました「固定資産除却損」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「特別損失」の「その他」として表示しております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「特別損失」に表示していた「固定資産除却損」0百万円は、「その他」0百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
建物	18百万円	20百万円
器具備品	251百万円	275百万円
投資建物	729百万円	-
投資器具備品	24百万円	-

2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
未払金	4,508百万円	4,084百万円

3 保証債務

前事業年度(平成26年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万円に対して保証を行っております。

当事業年度(平成27年3月31日)

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

(損益計算書関係)

1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)	当事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)
受取配当金	-	1,065百万円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26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

(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26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	10,126百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	3,882円
基準日	平成26年 3月31日
効力発生日	平成26年 6月26日

当事業年度(自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の総額(百万円)	1株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26年 6月26日

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

() 為替変動リスクの管理

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

() 価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成26年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	15,186	15,186	-
(2) 未収委託者報酬	8,265	8,265	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	22,283	22,283	-
資産計	45,735	45,735	-
(1) 未払手数料	4,277	4,277	-
(2) その他未払金	4,635	4,635	-
(3) 未払費用(*)	2,678	2,678	-
負債計	11,591	11,591	-

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

当事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,059	1,025
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,141	5,129
(3) 長期差入保証金	997	996

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26年3月31日）

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	15,186	-	-	-
未収委託者報酬	8,265	-	-	-
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	-	1,498	3,978	97
合計	23,452	1,498	3,978	97

当事業年度（平成27年3月31日）

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,438	-	-	-
未収委託者報酬	10,295	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	6	1,591	3,790	84
合計	41,740	1,591	3,790	84

(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26年3月31日）

子会社株式(貸借対照表計上額 5,141百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当事業年度(平成27年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度(平成26年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	113	55	58
(2) その他 証券投資信託	5,625	4,873	751
小計	5,738	4,928	809
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	16,544	16,586	41
小計	16,544	16,586	41
合計	22,283	21,514	768

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 1,059百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(平成27年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	164	55	109
(2) その他 証券投資信託	4,576	3,633	943
小計	4,741	3,688	1,052
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	5,779	5,793	14
小計	5,779	5,793	14
合計	10,520	9,482	1,038

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

3. 売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
その他 証券投資信託	24,501	64	3
合計	24,501	64	3

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,935百万円	1,959百万円
勤務費用	201	212
退職給付の支払額	217	118
その他	39	18
退職給付債務の期末残高	1,959	2,072

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

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

積立型制度の退職給付債務	-	-
年金資産	-	-
	-	-
非積立型制度の退職給付債務	1,959百万円	2,072百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072
退職給付引当金	1,959	2,072
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	1,959	2,072

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
勤務費用	201百万円	212百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	201	212

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別内訳

(単位：百万円)

	前事業年度	当事業年度
	(平成26年3月31日)	(平成27年3月31日)
繰延税金資産		
減損損失	833	-
退職給付引当金	698	670
賞与引当金	287	305
外国税関連費用	-	241
未払事業税	335	231
連結法人間取引(譲渡損)	141	128
投資有価証券評価損	128	105
出資金評価損	116	103
その他	246	206
繰延税金資産小計	2,789	1,992
評価性引当額	1,200	613
繰延税金資産合計	1,588	1,379
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,428	2,203

その他有価証券評価差額金	273	335
その他	1	-
繰延税金負債合計	2,704	2,539
繰延税金負債の純額	1,115	1,159

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

	前事業年度 (平成26年3月31日)	当事業年度 (平成27年3月31日)
法定実効税率	-	35.64%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	-	1.14%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	-	2.02%
評価性引当額の増減額	-	2.67%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	0.51%
その他	-	0.07%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	31.65%

(注) 前事業年度においては、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以下であるため記載を省略しております。

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第9号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成27年法律第2号）が平成27年3月31日に公布され、平成27年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の35.64%から平成27年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については33.10%に、平成28年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については32.34%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が44百万円、繰延税金負債（長期）が180百万円、法人税等調整額が100百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が34百万円増加しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

[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25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,719	-	-

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26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,834	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	--------------	------	---------	-------	---	---

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(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25年4月1日 至 平成26年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	25,994	未払手数料	3,216
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	678	未払費用	393
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	978	長期差入保証金	971

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)		当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	
1株当たり純資産額	14,705.91円	1株当たり純資産額	16,052.69円
1株当たり当期純利益	3,882.07円	1株当たり当期純利益	5,148.94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25年4月1日 至 平成26年3月31日)	当事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)
当期純利益(百万円)	10,126	13,431
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位:百万円)

当中間会計期間
(平成27年9月30日)

資産の部

流動資産

現金・預金

22,998

有価証券		4,461
未収委託者報酬		10,719
繰延税金資産		504
その他		334
流動資産合計		39,018
固定資産		
有形固定資産	1	247
無形固定資産		
ソフトウェア		2,432
その他		135
無形固定資産合計		2,568
投資その他の資産		
投資有価証券		5,468
関係会社株式		5,129
その他		1,231
投資その他の資産合計		11,830
固定資産合計		14,646
資産合計		53,664

(単位:百万円)

当中間会計期間

(平成27年9月30日)

負債の部

流動負債		
未払金		7,124
未払費用		4,744
未払法人税等		1,085
賞与引当金		903
その他	3	643
流動負債合計		14,500
固定負債		
退職給付引当金		2,142
役員退職慰労引当金		111
繰延税金負債		1,497
その他		2
固定負債合計		3,754

負債合計	18,255
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174
資本剰余金	
資本準備金	11,495
資本剰余金合計	11,495
利益剰余金	
利益準備金	374
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	8,096
利益剰余金合計	8,471
株主資本合計	35,141
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	267
評価・換算差額等合計	267
純資産合計	35,409
負債・純資産合計	53,664

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間	
	(自 平成27年4月1日	
	至 平成27年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		46,714
その他営業収益		435
営業収益合計		47,150
営業費用		
支払手数料		24,499
その他営業費用		6,487
営業費用合計		30,987
一般管理費	1	5,812
営業利益		10,350
営業外収益	2	378
営業外費用	3	29
経常利益		10,699
税引前中間純利益		10,699
法人税、住民税及び事業税		3,260
法人税等調整額		39
中間純利益		7,398

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 13,428	△ 13,428	△ 13,428
中間純利益	-	-	-	7,398	7,398	7,398
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	△ 6,029	△ 6,029	△ 6,029
当中間期末残高	15,174	11,495	374	8,096	8,471	35,141

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	702	702	41,873
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 13,428
中間純利益	-	-	7,398
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 434	△ 434	△ 434
当中間期変動額合計	△ 434	△ 434	△ 6,464
当中間期末残高	267	267	35,409

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

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成27年9月30日現在)
有形固定資産	239百万円

2 保証債務

当中間会計期間（平成27年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,765百万円に対して保証を行っております。

3 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日)
有形固定資産	15百万円
無形固定資産	532百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日)
外国税関連費用引当金戻入益	171百万円
投資有価証券売却益	99百万円
受取配当金	69百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日)
為替差損	13百万円
貯蔵品廃棄損	5百万円
投資有価証券売却損	2百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成27年 4月 1日 至 平成27年 9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

2. 配当に関する事項

配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成27年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,428	5,148	平成27 年 3月 31日	平成27年 6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成27年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

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

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	22,998	22,998	-
(2) 未収委託者報酬	10,719	10,719	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	8,908	8,908	-
資産合計	42,626	42,626	-
(1) 未払金	7,124	7,124	-
(2) 未払費用(*)	3,702	3,702	-
負債合計	10,827	10,827	-

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払金及び(2) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	当中間会計期間
非上場株式	1,021
子会社株式	5,129
差入保証金	1,052

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

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成27年9月30日)

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	161	55	106
(2) その他			
証券投資信託	3,455	3,002	453
小計	3,617	3,058	559
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	5,290	5,453	163
小計	5,290	5,453	163
合計	8,908	8,511	396

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

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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27年4月1日 至 平成27年9月30日）

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当中間会計期間（自 平成27年4月1日 至 平成27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27年4月1日 至 平成27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27年4月1日 至 平成27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27年4月1日 至 平成27年9月30日）
--

1株当たり純資産額	13,574.37円
1株当たり中間純利益金額	2,836.44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。

(注) 2. 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 平成27年4月1日 至 平成27年9月30日)	
中間純利益(百万円)	7,398
普通株式に係る中間純利益(百万円)	7,398
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

平成27年4月1日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 代表取締役の人数の変更（4名以内に変更）

平成27年6月26日付で、定款について次の変更をいたしました。

- ・ 取締役（業務執行取締役等であるものを除く。）の責任を法令の定める限度に制限する契約を締結できる旨の規定の新設

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

独立監査人の中間監査報告書

平成28年1月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日本株式セレクトの平成27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15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27年6月16日から平成27年12月15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 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年1月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 日本債券セレクトの平成27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15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27年6月16日から平成27年12月15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 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年1月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国株式セレクトの平成27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15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27年6月16日から平成27年12月15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 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年1月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15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27年6月16日から平成27年12月15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 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年1月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国債券セレクトの平成27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15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27年6月16日から平成27年12月15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 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年1月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている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27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15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27年6月16日から平成27年12月15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 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年1月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ J-REITセレクトの平成27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15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27年6月16日から平成27年12月15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 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年1月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ 外国REITセレクトの平成27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15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27年6月16日から平成27年12月15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 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年1月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ コモディティセレクトの平成27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15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27年6月16日から平成27年12月15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 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年1月22日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているダイワファンドラップ ヘッジファンドセレクトの平成27年6月16日から平成27年12月15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27年12月15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27年6月16日から平成27年12月15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 . XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

[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27年 5月28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26年4月1日から平成27年3月31日までの第56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27年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[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27年11月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	高波 博之	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	貞廣 篤典	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	内田 和男	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の中間会計期間（平成27年4月1日から平成27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27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27年4月1日から平成27年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注)2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。