

【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29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 岩本 信之

【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 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 日本債券セレクト
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 セレクト・シリーズ」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28年9月10日から平成29年9月8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28年9月9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】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後>の記載事項は原有価証券届出書の更新後の内容を示します。

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(3) 【ファンドの仕組み】

< 更新後 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成28年12月末日現在） >

< 略 >

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

< 更新後 >

主要投資対象

< 略 >

ファンド名	指定投資信託証券
-------	----------

FW日本株式セレクト	ダイワ・バリュー株・オープン(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	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)
	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(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	ダイワ成長株オープン(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
	ニッセイJ P X日経4 0 0アクティブファンド(F0Fs用)(適格機関投資家専用)
リサーチ・アクティブ・オープンF(適格機関投資家専用)	

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)
	ニッセイ米国配当成長株ファンド(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・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)
	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)
	グローバル・ディスカバリー・ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)(注)
	UBSグローバル・オポチュニティー(除く日本)株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)(注)
	ダイワ/ウエリントン・デュラブル・カンパニーズ戦略ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)(注)
	パリューパーターナーズ高配当株式ファンド(香港籍、米ドル建)
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・ユーエス・エクイティ・コンセントレイティド・ファンド」の投資証券(円建)	

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)
	ニッセイ米国配当成長株ファンド(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)
	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)
	グローバル・ディスカバリー・ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)(注)
	UBSグローバル・オポチュニティー(除く日本)株式ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)(注)
	ダイワ/ウエリントン・デュラブル・カンパニーズ戦略ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)(注)
	バリュートナーズ高配当株式ファンド(香港籍、米ドル建)
	アイルランド籍の外国証券投資法人「ラザード・グローバル・アクティブ・ファンズ・パブリック・リミテッド・カンパニー」が発行する「ラザード・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド」の投資証券(米ドル建)
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・ユーエス・エクイティ・コンセントレイテッド・ファンド」の投資証券(円建)	
ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「フィデリティ・ファンズ」が発行する「フィデリティ・ファンズ インスティテューショナル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド」のクラスI投資証券(円建)	

FW日本債券セレクト	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)
	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)
	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 (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	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)
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)
	L M ・ ブランディワイン外国債券ファンド (F O F s 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)
	ダイワ/デカ欧州債券アクティブ・ファンド (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	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)
	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 (F O F s 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 (FOFs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)
	ダイワ/デカ欧州債券アクティブ・ファンド (F0Fs用) (適格機関投資家専用)
	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)
	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)
	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)

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)
	SMAAM・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)
	グローバル・ボンドアルファ戦略ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)(注)
	ストラテジックCBファンド(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「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)
	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ブラックロック・ストラテジック・ファンズ」が発行する「ブラックロックUKエクイティ・アブソリュート・リターン・ファンド」の円ヘッジクラスI投資証券(円建)
	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「JPモルガン・インベストメント・ファンズ」が発行する「グローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド-JPMグローバル・マクロ・オポチュニティーズ(Iクラス)(円ヘッジ)」の投資証券(円建)
	アイルランド籍の外国証券投資法人「イートン・ヴァンス・インターナショナル(アイルランド)ファンズ・ピーエルシー」が発行する「イートン・ヴァンス・インターナショナル(アイルランド)グローバル・マクロ・ファンド」のクラスI2投資証券(円建)
ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ピクテ・トータル・リターン」が発行する「アトラスHJJPY(円ヘッジ)」の投資証券(円建)(注)	

上記は、平成29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29年3月9日に追加予定です。

<略>

(2) 【投資対象】

< 更新後 >

< 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	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）
運用の基本方針	< 略 >
主要な投資対象	< 略 >
委託会社の名称	アセットマネジメントOne株式会社

< 略 >

< FW外国株式セレクト >

< 略 >

投資先ファンドの名称	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	< 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	グローバル・ディスカバリー・ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長をめざして運用を行なうことを基本とします。
主要な投資対象	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
委託会社の名称	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社

投資先ファンドの名称	UBSグローバル・オポチュニティー（除く日本）株式ファンド(F0Fs用）（適格機関投資家専用）
------------	---

運用の基本方針	主として日本を除くグローバル株式に実質的に投資を行い、信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要な投資対象	UBSグローバル・オポチュニティー（除く日本）株式マザーファンド受益証券を通じて、日本を除くグローバル株式に投資します。
委託会社の名称	UBSアセット・マネジメント株式会社

投資先ファンドの名称	ダイワ/ウエリントン・デュラブル・カンパニーズ戦略ファンド（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（日本を含む）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。）
委託会社の名称	大和証券投資信託委託株式会社

< 略 >

< FW外国株式EM+ >

< 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	< 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	グロ - バル・ディスカバリー・ファンド（F0Fs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	信託財産の長期的な成長をめざして運用を行なうことを基本とします。
主要な投資対象	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
委託会社の名称	モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社

投資先ファンドの名称	UBSグローバル・オポチュニティー（除く日本）株式ファンド(F0Fs用）（適格機関投資家専用）
------------	---

運用の基本方針	主として日本を除くグローバル株式に実質的に投資を行い、信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要な投資対象	UBSグローバル・オパチュニティー（除く日本）株式マザーファンド受益証券を通じて、日本を除くグローバル株式に投資します。
委託会社の名称	UBSアセット・マネジメント株式会社

投資先ファンドの名称	ダイワ/ウエリントン・デュラブル・カンパニーズ戦略ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行いません。
主要な投資対象	世界（日本を含む）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。）
委託会社の名称	大和証券投資信託委託株式会社

< 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	アセットマネジメントOne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	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、ブルームバーグ・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	< 略 >
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	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（ブルームバーグ・バークレイズ・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	< 略 >
主要な投資対象	ブルームバーグ・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。
委託会社等の名称	< 略 >

< 略 >

< FW外国債券EM+ >

< 略 >

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、ブルームバーグ・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	< 略 >
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	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（ブルームバーグ・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	< 略 >
主要な投資対象	ブルームバーグ・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	< 略 >

< 略 >

< FWヘッジFセレクト >

< 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	< 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	グローバル・ボンドアルファ戦略ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	この投資信託は、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す。
主要な投資対象	D I A Mグローバル・ボンドアルファ戦略（積極型）マザーファンド受益証券を通じて、国内外の債券先物取引を行ないます。
委託会社の名称	アセットマネジメントOne株式会社

投資先ファンドの名称	ストラテジックCBファンド（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	この投資信託は、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。

主要な投資対象	ストラテジックC Bマザーファンドの受益証券を通じて、転換社債、転換社債型新株予約権付社債に投資を行なうとともに、信用取引による株式の空売りを行いません。
委託会社の名称	日興アセットマネジメント株式会社

< 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「イートン・ヴァンス・インターナショナル（アイルランド）ファンズ・ピーエルシー」が発行する「イートン・ヴァンス・インターナショナル（アイルランド）グローバル・マクロ・ファンド」のクラスI 2投資証券（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	ルクセンブルグ籍の外国証券投資法人「ピクテ・トータル・リターン」が発行する「アトラス HJ JPY（円ヘッジ）」の投資証券（円建）
運用の基本方針	投資対象ファンドの投資目的は世界株式へのロング・ショート戦略での投資によって長期的な絶対リターンを追求し投資元本の成長を目指すことです。
主要な投資対象	ファンドは主に株式、株式関連証券（普通株あるいは優先株など）、預金、マネーマーケット商品に投資します。
委託会社等の名称	管理会社：ピクテ・アセット・マネジメント（ヨーロッパ）エス・エイ 投資顧問会社：ピクテ・アセット・マネジメント・エス・エイ、ピクテ・アセット・マネジメント・リミテッド 保管会社・管理事務代行会社：BNP パリバ・セキュリティ・サービスズ、ルクセンブルグ・ブランチ 名義書換事務代行会社・支払事務代行会社：ファンドパートナー・ソリューションズ（ヨーロッパ）エス・エイ

< 略 >

平成29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 >

< FW J-REITセレクト >

投資対象ファンドの名称	日本ビルファンド投資法人
運用の基本方針・ 主要な投資対象	当投資法人は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づき、資産を主として特定資産に対する投資として運用することを目的および基本的性格として設立された法人であり、その資産の運用を委託する資産運用会社（日本ビルファンドマネジメント株式会社）がこれを運用するものです。当投資法人の特色は、主として東京都心部、東京周辺都市部および地方都市部に立地する主たる用途がオフィスである建物およびその敷地から構成される不動産ならびにかかる不動産を裏付けとする有価証券および信託の受益権その他の資産に投資することによって、中長期的な観点から、当投資法人に属する資産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行なうことです。
委託会社（資産運用会社） の名称	日本ビルファンドマネジメント株式会社

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	当投資法人は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づき、当投資法人の資産を主として特定資産に対する投資として運用することを目的とし、特に、主として「不動産等」および「不動産対応証券」の特定資産に投資し、中長期の安定運用をはかることを目標として運用を行ないます。当投資法人の投資する不動産および信託財産である不動産の用途は、主にオフィスビルとし、投資対象地域は、わが国の政令指定都市をはじめとする全国の主要都市とします。また、運用にあたっては、不動産および不動産を信託する信託の受益権への投資を基本としますが、投資環境、資産規模等によっては、その他の不動産等および不動産対応証券への投資を行ないます。
委託会社（資産運用会社） の名称	ジャパンリアルエステイトアセットマネジメント株式会社

(3) 【運用体制】

<更新後>

<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28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28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】

< 更新後 >

< 略 >

< 参考 > 指定投資信託証券等の概要

本項は、「ダイワファンドラップ セレクト・シリーズ」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29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・リミティド・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・円ヘッジクラス投資証券（円建）、バリューパートナーズ高配当株式ファンド（香港籍、米ドル建）、ラザード・グローバル・アクティブ・ファンズ・パブリック・リミティド・カンパニー/ラザード・ユーエス・エクイティ・コンセントレイティド・ファンド、フィデリティ・ファンズ インスティテューショナル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド、ブラックロック・ストラテジック・ファンズ - ブラックロックUKエクイティ・アプソリュート・リターン・ファンド、JPモルガン・インベストメント・

ファンズ・グローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド - JPMグローバル・マクロ・オポチュニティーズ（1クラス）（円ヘッジ）、イートン・ヴァンス・インターナショナル（アイルランド）グローバル・マクロ・ファンド、ピクテ・トータル・リターン - アトラス クラスHJ JPY（円ヘッジ）投資証券（円建）を除きます。また、グローバル・ボンドアルファ戦略ファンド（FOFs用）（適格機関投資家専用）は、株式会社りそな銀行および三井住友信託銀行株式会社が販売会社です。）

- ・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ないます。
主要投資対象	ダイワ・バリュー株・オープン・マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券
投資態度	<p>マザーファンドの受益証券を通じて、主としてわが国の上場株式を投資対象とし、取得時にPER、PBRなどの指標または株価水準から見て割安と判断される銘柄のうち、今後株価の上昇が期待される銘柄に投資します。ただし、取得した後にこの条件を満たさない銘柄であっても保有を継続することがあります。</p> <p>銘柄の選定にあたっては、主に次の観点から行ないます。</p> <p>イ. 事業の再構築力、新しい事業展開</p> <p>ロ. 本業の技術力、市場展開力</p> <p>ハ. 株主本位の経営姿勢</p> <p>マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の90%程度以上に維持することを基本とします。</p> <p>株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資は、原則として、信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p> <p>当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。</p>

マザーファンドの投資態度	<p>わが国の金融商品取引所()上場株式および店頭登録株式を主要投資対象とします。 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。 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。 銘柄の選定にあたっては、主に次の観点から行ないます。 イ. 事業の再構築力、新しい事業展開 ロ. 本業の技術力、市場展開力 ハ. 株主本位の経営姿勢 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。 株式への実質投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は、行ないません。</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。 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	<ul style="list-style-type: none"> ・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のが望ましいとされており、TOPIXが一般的に使用されています。 ・TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。 ・ベンチマークと当ファンドの基準価額の動きを比較した結果は、運用報告書でお知らせします。 ・なお、将来、ベンチマークとしてTOPIXに代わる指数を使用することが望ましいと一般的にみなされていると当社が判断した場合には、ベンチマークを当該指数に変更することがあります。 ・当ファンドは、TOPIXとの連動をめざすものではありません。また、TOPIXを上回る運用成果を保証するものではありません。
------------	--

2. G I M日本株・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	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、「日本株式DDM戦略」独自の業種分類に基づき、調査対象企業の長期的な業績予想を行います。 ・マザーファンドにおけるポートフォリオの構築にあたっては、アナリストやポートフォリオ・マネジャーの定性的な判断(主観的判断)のみに頼ることなく、配当割引モデル(DDM)等を通じてその修正を行います。 ・TOPIX(配当込み)を当ファンドのベンチマークとします。 ・TOPIX(配当込み)に対するリスクを一定水準に保ちつつ、安定した超過収益を積み上げることを目指します。 <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定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(バリュー・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 (F0Fs用) (適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。

主要投資対象	ダイワ好配当日本株マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)の受益証券
投資態度	<p>マザーファンドの受益証券を通じて、主としてわが国の金融商品取引所()上場株式に投資し、高水準の配当収入の確保と、値上がり益の獲得をめざします。</p> <p>金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。</p> <p>株式への投資にあたっては、予想配当利回りが高いと判断される銘柄を中心に、成長性、企業のファンダメンタルズ、株価の割安性等に着目し、投資銘柄を選定します。</p> <p>マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態でも高位(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(FOFs用) (適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	この投資信託は、信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とし、中長期的な信託財産の成長を目指して積極的に運用を行なうことを基本とします。</p> <p>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	収益分配対象額の範囲は、経費等控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価損益を含みます。)等の全額とします。 収益分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、収益分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。
信託期間	無期限(平成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	主に、マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式に、中長期的な信託財産の成長を目指して積極的に投資し、中長期的な値上がり益の追求を目指します。 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記のような運用ができない場合があります。 当ファンドは、原則としてファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。

主な投資制限	<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。</p> <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、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。</p> <p>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。</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。</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。</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。

6. 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)

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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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。</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>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。</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>外貨建資産への投資は行いません。</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、分配を行わないことがあります。</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	<p>信託報酬の総額は、投資信託財産の純資産総額に年率0.81%（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。</p> <p>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。</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。

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いません。
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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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>わが国の株式のうち中小型株を主要投資対象とします。</p> <p>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。</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、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>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。</p> <p>外貨建資産への実質投資は行いません。</p> <p>デリバティブ取引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。</p> <p>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。</p>
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	<p>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。</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:大和住銀投信投資顧問株式会社</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。

8. 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)

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(F O F s 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	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。 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。 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。
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:アセットマネジメントOne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)カタリスト: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)カタリスト: 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	毎年3月28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0.5184%(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。
ファンドの関係法人	委託会社: SBI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>
----------------	--

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います。)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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
マザーファンドの投資態度	<p>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。</p> <p>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。</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制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>為替予約は行いません。</p>
収益の分配	<p>分配対象額は、配当収益及び売買益とします。</p> <p>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。</p>
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. ダイワ成長株オープン (F0Fs用) (適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	ダイワ成長株マザーファンド(以下、「マザーファンド」といいます。)の受益証券
投資態度	<p>主として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上場株式および店頭登録株式の中から、今後の日本経済において成長が期待される国内企業およびグローバルな視点で成長が期待される国内企業に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>マザーファンドの運用にあたっては、以下の方針を基本とします。</p> <p>(a) 大和投資信託のアナリストおよび運用担当者による組織的な調査・分析に基づいて、中期的な成長性が期待される銘柄を選定します。</p> <p>(b) 銘柄の選定にあたっては、次の項目に着目して行なうことを基本とします。</p> <p>イ. 相対的に利益成長力があると期待される企業</p> <p>ロ. 自己変革によって利益成長が期待される企業</p> <p>ハ. 将来性が期待される事業の展開をはかる企業</p> <p>(c) ポートフォリオの組成にあたっては、証券取引所第一部上場株式以外の銘柄にも積極的に目を向けて組入れていくことを基本とします。</p> <p>(d) わが国の株価指数先物取引等を信託財産の純資産総額の範囲内で利用することがあります。</p> <p>(e) 株式の実質投資比率(現物株式の投資比率に先物取引の投資比率を加えた比率)は、通常の状態では70%程度以上とすることを基本とします。</p> <p>(f) TOPIX(東証株価指数)をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果をめざします。</p> <p>マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態では高位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。</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および店頭登録株式の中から、今後の日本経済において成長が期待される国内企業およびグローバルな視点で成長が期待される国内企業に投資します。</p> <p>運用にあたっては、大和投資信託のアナリストおよび運用担当者による組織的な調査・分析に基づいて、中期的な成長性が期待される銘柄を選定します。</p> <p>銘柄の選定にあたっては、次の項目に着目して行なうことを基本とします。</p> <p>イ. 相対的に利益成長力があると期待される企業 ロ. 自己変革によって利益成長が期待される企業 ハ. 将来性が期待される事業の展開をはかる企業</p> <p>ポートフォリオの組成にあたっては、証券取引所第一部上場株式以外の銘柄にも積極的に目を向けて組入れていくことを基本とします。</p> <p>わが国の株価指数先物取引等を信託財産の純資産総額の範囲内で利用することがあります。</p> <p>株式の実質投資比率（現物株式の投資比率に先物取引の投資比率を加えた比率）は、通常の状態では70%程度以上とすることを基本とします。</p> <p>TOPIX（東証株価指数）をベンチマークとして、中長期的にベンチマークを上回る投資成果をめざします。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>株式への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>投資信託証券（マザーファンドの受益証券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、分配を行わないことがあります。</p>
信託期間	無期限（平成28年9月12日当初設定）
決算日	<p>毎年6月15日（休業日の場合翌営業日）</p> <p>（第1計算期間は平成29年6月15日まで）</p>
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0.67068%（税抜 年0.621%）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：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。

13. ニッセイJPX日経400アクティブファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	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JPX日経400アクティブ 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>ニッセイJPX日経400アクティブ マザーファンドへの投資を通じて、実質的に成長が期待される日本企業の株式へ投資を行い、信託財産の中長期的な成長をめざします。</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>JPX日経インデックス400(配当込み)をベンチマークとします。</p> <p>株式以外の資産(上記マザーファンドを通じて投資する場合は、当該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、このファンド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>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、成長が期待される日本企業の株式へ投資を行い、信託財産の中長期的な成長をめざします。</p> <p>銘柄選定にあたっては、ROEの水準および変化、営業利益の水準および変化に着目し、経営効率に優れ利益成長力を有する銘柄に投資を行います。</p> <p>個別企業分析・株価評価に際しては、アナリストチームが統一的な手法により徹底した企業調査・分析を行い、経営戦略の評価、業績予想および株価評価を行います。</p> <p>ポートフォリオ構築に際しては、ポートフォリオマネジャーが成長の実現性、市場環境、流動性、株価指標等を分析・評価し、組入銘柄・組入比率の決定を行います。</p> <p>株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>JPX日経インデックス400(配当込み)をベンチマークとします。</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>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10%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>外貨建資産への投資は行いません。</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28年9月9日当初設定)
決算日	毎年1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率0.6804%(税抜0.63%)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: 三菱UFJ信託銀行株式会社
ベンチマーク	JPX日経インデックス400(配当込み)

ベンチマーク について	<p>JPX日経インデックス400は、資本の効率的活用や投資者を意識した経営観点など、グローバルな投資基準に求められる諸要件を満たした、「投資者にとって投資魅力の高い会社」で構成される新しい株価指数です。JPX日経インデックス400は、株式会社日本取引所グループ、株式会社東京証券取引所および株式会社日本経済新聞社が算出します。</p> <p>「JPX日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所(以下総称して「JPXグループ」といいます。)ならびに株式会社日本経済新聞社(以下「日経」といいます。)によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、「JPXグループ」および「日経」は、「JPX日経インデックス400」自体および「JPX日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。</p> <p>「JPX日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべて「JPXグループ」および「日経」に帰属しています。</p> <p>当ファンドは、ニッセイアセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、「JPXグループ」および「日経」は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。</p> <p>「JPXグループ」および「日経」は、「JPX日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。</p> <p>「JPXグループ」および「日経」は、「JPX日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。</p>
----------------	---

14. リサーチ・アクティブ・オープンF（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	リサーチ・アクティブ・オープンF(適格機関投資家専用)と実質的に同一の運用の基本方針を有する親投資信託であるリサーチ・アクティブ・オープン マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、直接株式に投資する場合があります。
投資態度	<p>わが国の株式を実質的な主要投資対象とし、信託財産の中・長期的な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。</p> <p>株式への投資に当っては、厳選した業績成長企業群(今期あるいは来期の利益成長が期待できる企業や将来の収益成長が期待できる企業等)に中・長期的な視野から投資します。</p> <p>非株式割合(株式以外の資産への実質投資割合)は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。</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>わが国の株式を主要投資対象とし、信託財産の中・長期的な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。</p> <p>株式への投資に当っては、厳選した業績成長企業群（今期あるいは来期の利益成長が期待できる企業や将来の収益成長が期待できる企業等）に中・長期的な視野から投資します。</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総額の50%以下を基本とします。</p> <p>なお、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</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>有価証券先物取引等は約款第27条の範囲で行ないます。</p> <p>スワップ取引は約款第28条の範囲で行ないます。</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>同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。</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>一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。</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、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。</p>
収益の分配	<p>運用による収益は、期中に分配を行わず、信託終了時まで信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。</p>
信託期間	無期限（平成13年8月28日当初設定）
決算日	毎年10月30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率0.6966%（税抜0.645%）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：野村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。

15．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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。)</p> <p>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。</p>
マザーファンドの投資態度	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。)</p> <p>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。</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に制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>

収益の分配	<p>分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益(マザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額を含みます。)および売買益(評価損益を含みます。ただし、マザーファンドの投資信託財産に属する配当等収益のうち、投資信託財産に属するとみなした額を除きます。)等の合計額とします。</p> <p>分配金額については、上記の範囲内で委託者が基準価額水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合や委託者の判断によって分配を行わないことがあります。</p> <p>収益分配に充てず投資信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて元本と同一の運用を行います。</p>
信託期間	無期限(平成24年3月7日当初設定)
決算日	毎年10月20日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	<p>信託報酬の総額は、投資信託財産の純資産総額に以下の率を乗じて得た額とします。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・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%) <p>他に監査費用、有価証券売買時の売買委託手数料等が投資信託財産から支払われます。</p>
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	<p>委託会社:MFSインベストメント・マネジメント株式会社</p> <p>受託会社:三井住友信託銀行株式会社</p> <p>マザーファンドの投資顧問会社:マサチューセッツ・ファイナンシャル・サービスズ・カンパニー</p>
ベンチマーク	MSCI コクサイ・インデックス(税引前配当込み・円ベース)
ベンチマークについて	<p>MSCIコクサイ・インデックス(税引前配当込み・円ベース)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要国で構成されているインデックスを円換算したものです。</p> <p>また、MSCIコクサイ・インデックスはMSCI Inc.の財産であり、「MSCI」はMSCI Inc.のサービスマークです。</p>

16. ニッセイ米国配当成長株ファンド（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	安定した配当等収益の獲得と信託財産の着実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、ニッセイ米国配当成長株 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のうち長期にわたる連続増配銘柄に投資することにより、安定した配当等収益の獲得と信託財産の着実な成長をめざします。</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>主として米国の株式のうち、長期にわたる連続増配銘柄に投資を行います。投資にあたっては、配当実績、利益や配当の継続性、時価総額規模、流動性等を勘案して運用を行うことを基本とします。</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（ニッセイ米国配当成長株 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、ニッセイ米国配当成長株 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0.31428%（税抜0.291%）</p> <p>500億円超の部分年率0.30888%（税抜0.286%）</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	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
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。

17. 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)

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	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:ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー
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。

18. 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）

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。

19. 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)

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。 ^{0.9} 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。 ^{0.9} 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。

20. 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ないます。
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。

21. 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	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。 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。
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	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。 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。 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。 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。 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。
マザーファンドの 投資態度	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。 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。 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。 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。 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。 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。 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。

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。

22. 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ないます。

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 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</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。

23. グロ - バル・ディスカバリー・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	信託財産の長期的な成長をめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	日本を除く世界各国の株式を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として日本を除く世界各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。)されている株式(預託証券を含みます。)に投資を行い、信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。</p> <p>銘柄選択にあたっては、ボトムアップの個別企業調査に基づいて、企業の規模や新旧にとらわれず、持続的な競争優位性のある質の高い企業を厳選します。</p> <p>MSCIコクサイ・インデックス(配当込み・円換算ベース)をベンチマークとします。</p> <p>モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インクに運用の指図に係る権限を委託します。</p> <p>株式の組入比率は、通常の状態でも高位を維持します。</p> <p>外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジは行いません。</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>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p> <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、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。</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、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、分配対象額が少額等の場合には委託者の判断で分配を行わないことがあります。</p>
信託期間	無期限(平成29年3月8日当初設定)
決算日	<p>毎年9月10日(休業日の場合翌営業日)</p> <p>第1計算期間は当初設定日～平成29年9月11日(月)。</p>

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0.7938% (税抜0.735%) 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:モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社 受託会社:三井住友信託銀行株式会社 投資顧問会社:モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント・インク
ベンチマーク	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み・円換算ベース)
ベンチマーク について	MSCIコクサイ・インデックスは、MSCI Inc.が開発した株価指数です。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。

24. UBSグローバル・オポチュニティー（除く日本）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	この投資信託は、主として日本を除くグローバル株式に実質的に投資を行い、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	UBSグローバル・オポチュニティー(除く日本)株式マザーファンド(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	主として、マザーファンドへの投資を通じて、日本を除くグローバル株式に投資を行います。 株式への投資にあたっては、トップダウンの市場・経済環境認識とボトムアップの個別銘柄選択を総合し たアクティブ運用を行い、特定のスタイルバイアスを持ちません。 ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)*とします。 マザーファンドの組入れについては高位を維持することを基本とします。 信託財産のリスク軽減のため、デリバティブ取引を行うことがあります。 資金動向、信託財産の規模、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイ・インデックス(配当 込み)を委託会社が独自に円換算したものです。
マザーファンドの 投資態度	主として日本を除くグローバル株式に投資を行います。 株式への投資にあたっては、トップダウンの市場・経済環境認識とボトムアップの個別銘柄選択を総合し たアクティブ運用を行い、特定のスタイルバイアスを持ちません。 ベンチマークは、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)*とします。 信託財産のリスク軽減のため、デリバティブ取引を行うことがあります。 UBSアセット・マネジメント(UK)リミテッドに、運用の指図に関する権限を委託します。 資金動向、信託財産の規模、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。 MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイ・インデックス(配当 込み)を委託会社が独自に円換算したものです。

主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>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%以内とします。</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%以内とします。</p> <p>デリバティブ取引の利用はヘッジ目的に限定します。</p> <p>外貨建資産への投資割合には制限を設けません。</p> <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、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、原則として以下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(マザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち信託財産に属するとみなした額(以下「みなし配当等収益」といいます。))を含みます。)および売買益(評価益を含み、みなし配当等収益を控除して得た額をいいます。)等の合計額とします。</p> <p>収益分配金額は、の範囲内で、委託者が市況動向等を勘案して委託者が決定します。ただし、委託者の判断で、分配を行わないことがあります。</p> <p>収益の分配にあてなかった利益については、運用の基本方針に基づいて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29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)
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0.891%(税抜0.825%)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:UBS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:UBSアセット・マネジメント(UK)リミテッド</p>
ベンチマーク	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)
ベンチマークについて	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み、円換算ベース)は、MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)を委託会社が独自に円換算したものです。

25. ダイワ/ウエリントン・デュラブル・カンパニーズ戦略ファンド(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	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	世界(日本を含む、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いません。</p> <p>株式等にはDR、REITおよび新株予約権証券を含みます。</p> <p>世界の企業の中から、主として景気サイクルに影響されにくい安定した事業運営を続ける企業の株式等に投資します。</p> <p>株式等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>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29年3月9日当初設定)
決算日	毎年6月15日(第1計算期間は平成29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1.04868%(税抜0.971%)以内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。

26. バリュートナーズ高配当株式ファンド(香港籍、米ドル建)

形態	外国投資信託 / 香港籍、米ドル建
----	-------------------

運用の基本方針	主としてアジア市場の好配当の株式や高利回りの債券に投資することにより、安定的な収益の確保を目指しています。
主要投資対象	アジア各国における上場株式を主な投資対象とします。
投資態度	<p>特に高い配当利回りを持つアジア域内の株式への投資に焦点を当てつつ、安定的なリターンを得ることをめざします。ボトムアップの投資方法を通じて、企業の投資価値を見極め、ポテンシャルのある企業の選別が可能となります。</p> <p>ファンドの投資目的を達成するため、バリュー投資戦略とボトムアップのアプローチを取り入れています。</p> <p>ポートフォリオの銘柄を短期の値動きではなく、長期的なリターンを狙うバイ・アンド・ホールド投資手法を採用しています。株式などの投資資産を長期間に渡って持ち続けることで、投資対象が本来持つ成長性を捉えたり、長期的な利益を獲得したりすることにより、投資成果を大きく上げることを目標としています。</p>
主な投資制限	<p>ファンドマネージャーは、低格付(最大30%)の債券や有価証券に投資することができます。ファンドの組み入れ資産は、現預金、短期国債・預金証書・銀行の引受といった短期債券およびその他の固定利付証券を含むことができます。さらに、現金または現金同等物を保有することもできます。</p> <p>当ファンドは、上海・香港ストックコネク(上海・香港の両証取が相互に上場株式の売買注文を取り次ぐ「滬港通」)を通じて中国A株式市場に直接投資することができます。深セン・香港ストックコネク(深セン・香港の両証取が相互に上場株式の売買注文を取り次ぐ「深港通」)を通じて中国A株式市場に直接投資することができます。また、中国A株アクセス商品(「CAAP」)を通じて中国A株市場に間接的に投資することもできます。</p> <p>中国A株式への投資額上限はポートフォリオのNAV20%とします。また単一CAAP発行体によって発行されたCAAPsに投資する上限はポートフォリオのNAVの10%とします。また、中国B株式への投資額はポートフォリオNAVの0~20%の間とします。</p> <p>補助的な投資としては、商品取引、先物取引、オプション、預託証券、ワラント、転換社債にも投資することができます。またリスクをヘッジする目的に、インデックスと通貨スワップおよび為替予約に投資することも認められます。ただし、当ファンドは資産担保証券(資産担保コマーシャル・ペーパーを含む)に投資することができません。</p>
収益の分配	分配金が自動的に再投資されます。(累積投資型)
信託期間	無期限(平成14年9月2日当初設定)
決算日	毎年12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: 1.25%</p> <p>実績報酬: あらかじめ決められた純資産総額の増加部分に対して15%を実績報酬料金とします。</p>
ファンドの 関係法人	<p>投資運用会社: Value Partners Hong Kong Limited</p> <p>副投資顧問会社: 該当なし</p> <p>管理事務代行会社: HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited</p> <p>保管会社: HSBC Institutional Trust Services (Asia) Limited</p>

ベンチマーク	インデックスに追従しない脱市場投資(BMA)手法を採用しているものの、MSCI AC Asia (ex-Japan) Indexを参考にしています。
ベンチマークについて	MSCI AC Asia (ex-Japan) Index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。

27. 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・ユーエス・エクイティ・コンセントレイテッド・ファンド

形態	アイルランド籍の外国証券投資法人/円建
運用の基本方針	主に米国の株式に投資することにより投資元本の中長期的な成長を目指します。
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の株式および株式関連証券(優先株、ワラント、ライツ、預託証券、転換社債等)を主な投資対象とします。
投資態度	株式および株式関連証券への投資を通じて、ファンドの投資元本の成長を目指します。当戦略では、通常、15～35銘柄程度の銘柄を選択し、集中型の投資を行います。銘柄の取得時において、時価総額が3.5億米ドル以上の銘柄を投資対象とします。財務生産性が優れている、あるいは改善している企業に着目した銘柄選択を行います。セクター/業種別保有比率は、ボトムアップによる銘柄選択プロセスの結果として生じるものであり、予めセクター/業種ウェイトに関する意思決定を行うことはありません。セクター及び業種別保有比率は、ポートフォリオのリスク・モニタリングの過程の一環として考慮されます。市場動向や資金動向等によっては、上記の運用が行われない場合があります。
主な投資制限	同一銘柄の株式への投資割合はファンドの純資産総額の10%以下とします。借入はファンドの純資産総額の10%以下とします。
収益の分配	アキュムレーティング・クラスの場合、収益の分配は行いません。
信託期間	無期限(平成27年12月23日当初設定)
決算日	毎年3月31日
管理報酬等	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:0.75% 事務代行費用等:最大0.30% 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。
ファンドの関係法人	管理会社:ラザード・ファンド・マネジャーズ(アイルランド)・リミテッド 運用会社:ラザード・アセット・マネジメント・エルエルシー 管理事務代行会社:BNYメロン・ファンド・サービシズ(アイルランド)・デジグネイテッド・アクティビティ・カンパニー
ベンチマーク	S&P 500指数(税引後配当込み)

ベンチマークについて	S&P500指数は、米国の主要産業を代表する500社により構成されている時価総額加重型の株価指数です。ラザードは同指数を運用しておらず、同指数には売買手数料等は含まれておりません。また、同指数に直接投資することはできません。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はS&Pダウ・ジョーンズ・インデックスに帰属しております。
------------	---

28. ダイワ新興国株式ファンド（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ひます。)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。

29. 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

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	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。 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。 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。 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。 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。 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。
収益の分配	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。 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。
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	信託財産の純資産総額に下記の率(年率)を乗じた額 運用報酬等:1.00% 事務代行費用等:最大0.30% 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。
ファンドの関係法人	管理会社:ラザード・ファンド・マネジャーズ(アイルランド)・リミテッド 運用会社:ラザード・アセット・マネージメント・エルエルシー 管理事務代行会社:BNYメロン・ファンド・サービス(アイルランド)・デジグネイティド・アクティビティ・カンパニー
ベンチマーク	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(税引後配当込み)
ベンチマークについて	MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

30. フィデリティ・ファンズ インスティテューショナル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド

形態/表示通貨	ルクセンブルグ籍証券投資法人/日本円建
運用の基本方針	この投資信託は、投資信託財産の成長を図ることを目的として運用を行ないます。
主要投資対象	主として、中南米、東南アジア、アフリカ、東欧(ロシアを含む)および中東を含む急速な経済成長を遂げている国々の企業が発行する株式に投資を行ないます。
投資態度	1) ファンドはその純資産において直接的に中国A株、及びB株にも投資をすることができます。 2) 参照指数はMSCIエマージング・マーケット・インデックスですが、インデックスに含まれない国・地域、及び企業に投資を行うこともあります。 3) 当ファンドは、運用部長主催の運用部内ミーティングを持ち、ポートフォリオのレビューを定期的に行います。
収益の分配	なし
信託期間	無期限
決算日	毎年4月末
管理報酬等	管理報酬:0.80% ・その他の手数料等については、運用状況等により変動しますので事前に料率、上限額等を表示することができません。 ・その他の手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。
ファンドの関係法人	投資運用会社:FILファンド・マネジメント・リミテッド(バミューダ) 管理会社:FIL・インベストメント・マネジメント(ルクセンブルグ)エス・エイ 管理事務代行会社:ブラウン・ブラザーズ・ハリマン(ルクセンブルグ)エス・シー・エイ

参照指数	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)
参照指数について	MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	主としてわが国の公社債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。
主要投資対象	主としてマニユライフ日本債券アクティブ・マザーファンド(以下、「マザーファンド」といいます。)受益証券に投資します。なお、コマーシャル・ペーパーなど短期金融商品等に直接投資する場合があります。
投資態度	マザーファンド受益証券を主たる投資対象とします。 NOMURA-BPI総合をベンチマークとして、円建て公社債(ユーロ円債を含む)のうち、主として投資適格債券に実質的に投資することによって、中長期的に同指標を上回る運用を目指します。マザーファンドの受益証券の組入比率は原則として高位を保ちます。 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。 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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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・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総合とは、野村証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。野村証券株式会社は、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>

32. 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)

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いません。
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着眼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。</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すぎません。</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	<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。
----------------	-------------

33. 明治安田日本債券アクティブ・ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	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(評価益を含みません)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	毎年2月26日および8月26日(休業日の場合翌営業日)

管理報酬等	<p>信託報酬の総額は、純資産総額に対して年率0.3024%(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>

34. 損保ジャパン日本興亜RMBS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	RMBSおよびMBSを主要投資対象とします。
投資態度	<p>主としてRMBS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RMBS分析を行い、割安度が高い銘柄を選定するRMBS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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(新発10年国債の利回りが)</p> <p>イ. 1%未満の場合 ...年率0.1944%(税抜0.18%)</p> <p>ロ. 1%以上2%未満の場合 ...年率0.2376%(税抜0.22%)</p> <p>ハ. 2%以上3%未満の場合 ...年率0.2808%(税抜0.26%)</p> <p>ニ. 3%以上4%未満の場合 ...年率0.3240%(税抜0.30%)</p> <p>ホ. 4%以上の場合 ...年率0.3672%(税抜0.34%)</p> <p>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。

35. 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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ます。)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	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、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：アセットマネジメントOne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。

36. NN国内債券ファンド（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向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> <ol style="list-style-type: none"> (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 <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向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、経費控除後の利子・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	毎年2月26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、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)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" data-bbox="369 1310 1299 1406"> <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	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。

37. 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、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p> <p>当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。</p>
マザーファンドの投資態度	<p>主として、わが国の国債に投資し、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。</p> <p>わが国の国債への投資にあたっては、原則として、最長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	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ません。 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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、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、分配を行わないことがあります。
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、純資産総額に対して年率0.31428%(税抜0.291%)以内とします。 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。 (新発10年国債の利回りが) イ. 2%未満の場合 ...年率0.14148%(税抜0.131%) ロ. 2%以上3%未満の場合 ...年率0.18468%(税抜0.171%) ハ. 3%以上4%未満の場合 ...年率0.22788%(税抜0.211%) ニ. 4%以上5%未満の場合 ...年率0.27108%(税抜0.251%) ホ. 5%以上の場合 ...年率0.31428%(税抜0.291%)
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。

38. 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	B A M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	<p>分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。</p> <p>分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向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:ベ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。

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。

40. 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	<p>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。</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。

41. 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。

42. ダイワノデカ欧州債券アクティブ・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	1. 欧州の債券 2. 金融商品取引所上場の債券先物取引および債券先物オプション取引
投資態度	<p>主として、欧州の政府、欧州の政府関係機関、欧州の企業、欧州の国際機関が発行する債券に投資するとともに、欧州の債券先物取引、欧州の債券先物オプション取引を活用することで、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いません。</p> <p>先物取引等の買建玉および売建玉の時価総額を合計した額は、信託財産の純資産総額の200%程度を上限とします。なお、オプション取引は先物に換算するものとします。</p> <p>投資対象とする銘柄は、取得時において投資適格(ムーディーズでBaa3以上またはS & PもしくはフィッチでBBB - 以上)の格付けを有するものとします。</p> <p>デュレーション、イールドカーブ、クレジットスプレッド、国別構成、通貨別構成、債券セクター別構成等を勘案し、ポートフォリオを構築します。</p> <p>投資成果の向上を図るため、為替予約取引をヘッジ目的以外で行なうことがあります。</p> <p>外貨建資産の運用にあたっては、デカ・インベストメント社に運用の指図にかかる権限を委託します。</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>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>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>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	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、分配を行わないことがあります。
信託期間	無期限(平成28年9月12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29年6月15日まで)
管理報酬等	信託報酬の総額は、投資信託財産の純資産総額に年0.47628%(税抜年0.441%)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 投資顧問会社:デカ・インベストメントGmbH
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. 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)

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、ブルームバーグ・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。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もありますが、経済的レバレッジは取りません。</p> <p>管理会社は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>
------	---

<p>主な投資制限</p>	<p>債券デリバティブのエクスポージャーは、ネットではファンドの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。投資適格未滿(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 未滿)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>
<p>収益の分配</p>	<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>
<p>信託期間</p>	<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>
<p>決算日</p>	<p>毎年12月31日</p>
<p>管理報酬等</p>	<p>運用報酬0.45%(年率)、その他に管理費用がかかります。</p> <p>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。</p>
<p>ファンドの 関係法人</p>	<p>(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</p>
<p>ベンチマーク</p>	<p>ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合債券指数(除く日本)</p>

ベンチマークについて	ブルームバーグ・バークレイズ・グローバル総合債券指数(除く日本)は、ブルームバーグが算出、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。従前、バークレイズ・グローバル総合債券指数(除く日本)と呼ばれていました。ブルームバーグは2016年8月24日にブルームバーグ・バークレイズ指数をバークレイズから取得しました。ブルームバーグ(BLOOMBERG)は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー(Bloomberg Finance L.P.)の商標およびサービスマークです。バークレイズ(BARCLAYS)は、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシー(Barclays Bank Plc)の商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックス(BLOOMBERG BARCLAYS INDICES)に対する一切の独占的権利を有しています。
------------	---

44. 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(ブルームバーグ・バークレイズ・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	<p>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(ブルームバーグ・バークレイズ・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。</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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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。</p>

主な投資制限	<p>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。</p>
収益の分配	<p>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。</p>
信託期間	<p>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。</p>
決算日	<p>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</p>
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： ・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% 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	<p>(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・ブラザース・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</p>

ベンチマーク	ブルームバーグ・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	ブルームバーグ・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、ブルームバーグが開発、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。ブルームバーグ(BLOOMBERG)は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー(Bloomberg Finance L.P.)の商標およびサービスマークです。バークレイズ(BARCLAYS)は、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシー(Barclays Bank Plc)の商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックス(BLOOMBERG BARCLAYS INDICES)に対する一切の独占的権利を有しています。

45. 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ないます。
主要投資対象	ブルームバーグ・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	ブルームバーグ・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。
主な投資制限	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。
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	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

管理報酬等	運用報酬および費用は以下の通りとなります。 ・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% 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。
ファンドの 関係法人	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: ブルームバーグ・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
ベンチマーク	ブルームバーグ・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	・ブルームバーグ・バークレイズ・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。 ・ブルームバーグ(BLOOMBERG)は、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピー(Bloomberg Finance L.P.)の商標およびサービスマークです。バークレイズ(BARCLAYS)は、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシー(Barclays Bank Plc)の商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックス(BLOOMBERG BARCLAYS INDICES)に対する一切の独占的権利を有しています。

46. 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)

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	ブルームバーグ・バークレイズ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	<p>ブルームバーグ・バークレイズ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。</p> <p>ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。</p> <p>バークレイズは、ライセンスに基づき使用されているバークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社(以下「ブルームバーグ」と総称します。)またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・バークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。</p>

(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出入の動向を反映して、一定の調整が行われます。これは、資金の流出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出入の動向が、純資産価格に影響を与えることになります。

47. 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	<p>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。)</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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。)</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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。</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5%以内とします。</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%以内とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資には制限を設けません。</p> <p>デリバティブの活用はヘッジ目的に限定しません。</p>
収益の分配	<p>分配対象額の範囲は、経費控除後の利子・配当収益および売買益(評価損益も含まれます。)等の範囲内とします。</p> <p>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。</p>
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。

48. 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)

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

マザーファンドの投資態度	<p>主として、新興国の国家機関が発行する米ドル建ての債券に投資し、新興国の債券市場の中長期的な値動きを概ね捉える投資成果をめざして運用を行ないます。</p> <p>新興国の国家機関が発行する米ドル建て以外の債券、米国の国家機関および国際機関が発行する債券にも投資する場合があります。米ドル建て以外の債券に投資する場合、原則として、為替予約取引および直物為替先渡取引等を活用し、実質的に米ドル建てとなるように為替取引を行ないます。</p> <p>運用の効率化を図るため、債券先物取引を利用することがあります。このため、債券の組入総額および債券先物取引の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。</p> <p>為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは原則として行ないません。</p> <p>当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。</p>
主な投資制限	<p>マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。)の行使等により取得したものに限りません。株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券(マザーファンドの受益証券および上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p>
収益の分配	<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	<p>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。</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。

49. 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・ダイバースィファイド)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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</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>
主な投資制限	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>レバレッジは使用しません。</p> <p>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。</p>
収益の分配	<p>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。</p> <p>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。</p>
信託期間	信託証書の日付(平成27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>運用報酬</p> <table> <tr> <td>純資産総額</td> <td>年率</td> </tr> <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> </table> <p>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</p> <p>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。</p>	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	<p>（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</p>								
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								
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。								

50. 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	<p>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。</p>

投資態度	<p>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。</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. 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。</p> <p>ロ. 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。</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>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>外貨建資産への直接投資は、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。

51. ダイワ海外REIT・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	<p>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。)</p> <p>金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。</p>

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	<p>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。</p>
信託期間	<p>無期限(平成18年11月28日当初設定)</p>
決算日	<p>毎年3月15日および9月15日(休業日の場合翌営業日)</p>
管理報酬等	<p>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。</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 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ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。</p>
ベンチマーク	<p>S & P先進国REIT指数(除く日本、円換算)</p>
ベンチマークについて	<p>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。</p>

52. ダイワ・マネー・マザーファンド

形態	証券投資信託 / 親投資信託
運用の基本方針	主としてわが国の公社債への投資により、利息収入の確保をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	本邦通貨表示の公社債
投資態度	わが国の公社債を中心に安定運用を行ないます。 邦貨建資産の組入れにあたっては、取得時に第二位(A-2格相当)以上の短期格付であり、かつ残存期間が1年未満の短期債、コマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。 当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。
主な投資制限	株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権(新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。))の新株予約権に限ります。)の行使等により取得したものに限りません。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 投資信託証券への投資は、行ないません。 同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は、行ないません。
収益の分配	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
信託期間	無期限(平成16年12月10日当初設定)
決算日	毎年12月9日(休業日の場合翌営業日)
管理報酬等	信託報酬はかかりません。有価証券売買時の売買委託手数料等が信託財産から支払われます。
ファンドの関係法人	委託会社:大和証券投資信託委託株式会社 受託会社:三井住友信託銀行株式会社
ベンチマーク	該当事項はありません。
ベンチマークについて	該当事項はありません。

53. 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	<p>・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。</p> <p>・RICIは、37種類(平成28年12月末現在)の商品先物で構成される指数です。</p> <p>・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。</p> <p>・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。</p> <p>・RICIは、投資可能性を考慮に入れた実用性の高い指数です。</p>

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

形態	追加型株式投資信託
----	-----------

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

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

形態	追加型株式投資信託
運用の基本方針	マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の株式へ投資するとともに、株価指数先物取引等の派生商品取引を活用し、株式市場の変動リスクの低減を図りつつ、安定的な収益の獲得を目指して運用を行います。
主要投資対象	大和住銀ジャパン・スペシャル・マザーファンドへの投資を通じて、わが国の株式を主要投資対象とします。また、株式市場の変動リスクの低減を図ることを目的として、株価指数先物取引等の派生商品取引を活用します。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、わが国の株式を主要投資対象とし、銘柄調査を重視したアクティブ運用を行います。</p> <p>運用にあたっては、ボトムアップ・アプローチにより、「ファンダメンタル価値対比割安なバリュー銘柄」と「将来収益への成長期待が高いグロース銘柄」を中心に投資します。現物株式(マザーファンドの信託財産に属する株式のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含む。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以上とします。株式以外の資産(マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含む。)への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>実質株式組入について、株式市場の変動リスクの低減を図ることを目的として、株価指数先物取引等の派生商品取引を活用します。</p> <p>資金動向、市況動向、残存期間等およびやむを得ない事情が発生した場合は上記のような運用ができない場合があります。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引及び金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引及び金利にかかるオプション取引と類似の取引(以下「有価証券先物取引等」といいます。)を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことができます。</p> <p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行うことができます。</p>

マザーファンドの投資態度	<p>わが国の株式を主要投資対象とし、銘柄調査を重視したアクティブ運用を行います。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。

56．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> 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います。 わが国の国債の組み入れは純資産総額の50%以上とします。 有価証券店頭指数等先渡取引のネット買建額の信託財産の純資産総額に対する割合は、原則として高位を保ちます。 有価証券店頭指数等先渡取引の相手方との間で、原則として現金による担保の差入若しくは受入を行います。 ファンドの設定解約動向その他の資金動向、市場動向等により、若しくは当初設定時、償還時、決算時等においては、上記のような運用が行われない場合があります。</p> <p><イールドカーブ戦略マザーファンド> 店頭デリバティブ取引をヘッジ目的以外に積極的に利用し、原則として有価証券店頭指数等先渡取引の買建を通じて、実質的にイールドカーブ戦略インデックスのパフォーマンスに連動する投資成果を獲得することで、市場動向にかかわらず安定した収益の獲得をめざして運用を行います。 わが国の国債の組み入れは純資産総額の50%以上とします。 有価証券店頭指数等先渡取引のネット買建額の信託財産の純資産総額に対する割合は、原則として高位を保ちます。 有価証券店頭指数等先渡取引の相手方との間で、原則として現金による担保の差入若しくは受入を行います。 ファンドの設定解約動向その他の資金動向、市場動向等により、若しくは当初設定時、償還時、決算時等においては、上記のような運用が行われない場合があります。</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。 株式(投資信託証券の性質を有するものを除きます。)への投資は、転換社債の転換または新株予約権の行使により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への直接投資は行いません。 デリバティブ取引の利用は、ヘッジ目的に限定しません。</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。 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	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。

57. 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	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。 信託の計理およびこれに付随する業務や法定書類の作成・交付に要する費用等(これらの業務を外部に委託する場合も含まれます。)、また、信託の監査人および法律顧問等に対する報酬や費用等も信託財産中から支弁されます。
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。

58. 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	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。 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。 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。 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	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。 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。 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	<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(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。

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。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。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	委託会社:三井住友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。

60. グローバル・ボンドアルファ戦略ファンド(F O F s 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す。
主要投資対象	DIAMグローバル・ボンドアルファ戦略(積極型)マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
投資態度	<p>主として、DIAMグローバル・ボンドアルファ戦略(積極型)マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の債券先物取引を用いたロング・ショート戦略により、絶対収益の獲得をめざします。</p> <p>マザーファンドの組入比率は、原則として高位を保ちます。</p> <p>実質外貨建て資産については、原則として為替フルヘッジを行います。</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>

マザーファンドの 投資態度	<p>この投資信託は、内外の債券先物を用いたロング・ショート戦略を駆使することで絶対収益を追求することをめざします。</p> <p>当社独自の定量モデルを活用した、以下の3つの戦略を組み合わせることを基本に、安定した超過収益の獲得をめざします。</p> <ul style="list-style-type: none">・長期コア戦略(1):各国のインカム水準とリスクをベースに中長期的にアルファの獲得をめざします。・市場間レラティブバリュー戦略(2):各国間の相対スプレッドの推移から短期的な歪みを捉えてアルファの獲得をめざします。・市場内(イールドカーブ)レラティブバリュー戦略(3):各国内のイールドカーブの形状から短期的な歪みを捉えてアルファの獲得をめざします。 <p>各戦略へのリスク配分は、1: 2: 3 = 4:2:1とすることを基本とします。ただし、市場環境や収益獲得機会の有無等によっては上記のような比率にならない場合があります。</p> <p>ファンド全体の金利変動リスクを極力回避するため、各戦略内およびファンド全体のデュレーションは概ねゼロとすることを基本とします。</p> <p>先物の買建金額および売建金額はそれぞれ信託財産の純資産総額の800%以内とします。先物の買建金額および売建金額の差額は、信託財産の純資産総額の-160% ~ 160%とします。</p> <p>債券先物に加え、オンバランス資産として国内外の債券および短期金融資産も主たる投資対象とします。</p> <p>外貨建資産の対円為替リスクについては、原則として為替予約にてヘッジします(*)。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資するため、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、通貨にかかる先物取引、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、通貨にかかる先物取引、通貨にかかるオプション取引(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、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下、「スワップ取引」といいます。)を行うことができます。</p> <p>ファンドの資金動向、市況動向等に急激な変化が生じた場合、ならびに純資産総額が運用に支障をきたす水準となった場合等、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>(*)対円為替予約比率(外貨建資産に対する為替予約時価の割合)は、80 ~ 120%とします。</p>
------------------	--

主な投資制限	<p>マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p> <p>株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%未満とします。</p> <p>マザーファンド受益証券以外の投資信託証券(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>スワップ取引、金利先渡し取引、為替先渡し取引、有価証券先物取引等の利用はヘッジ目的に限らず行うことができます。</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実質比率は、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>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>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29年1月4日当初設定)
決算日	毎年6月10日(第1計算期間は平成29年6月12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0.5238%(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:アセットマネジメントOne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。

61. ストラテジックCB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、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行いません。
主要投資対象	ストラテジックCB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、ストラテジックCBマザーファンド受益証券に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行ないます。</p> <p>マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を保つことを原則とします。なお、資金動向等によっては組入比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>
マザーファンドの投資態度	<p>主として、転換社債、転換社債型新株予約権付社債を中心に投資を行なうとともに、転換社債、転換社債型新株予約権付社債と、信用取引による株式の空売りによる裁定取引を行ない、中長期的に安定的な収益の獲得を目指します。</p> <p>信託財産全体における実質平均残存年限は、原則として2～4年となるように調整します。</p> <p>ポートフォリオの平均格付(格付は、格付投資情報センター、日本格付研究所、ムーディーズ・インベスターズ・サービス、スタンダード・アンド・プアーズ・レーティングズ・サービスズの順に各社が付与した格付を用いるものとします。ただし、いずれの社も格付を付与していない場合には、委託者が当該格付と同等の信用度を有すると判断したものをを用いるものとします。)は、原則としてBBB相当以上となるように投資を行ないます。</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>
主な投資制限	<p>株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合には、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>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なうこととします。</p>
収益の分配	<p>毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行ないます。</p> <p>分配対象額は、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。</p> <p>分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。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29年2月28日当初設定)
決算日	毎年2月15日および8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0.5346% (税抜0.495%)の率を乗じて得た額とします。また、運用報告書などの作成および交付に係る費用、監査費用などについては、信託財産の日々の純資産総額に対して年率0.1%を乗じた額の信託期間を通じた合計を上限として、信託財産から支払うことができます。この他に、有価証券売買時の売買委託手数料、信託事務の処理に要する諸費用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:日興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。

62. 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『カタルスト』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(投資適格未満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>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

63. ブラックロック・ストラテジック・ファンズ - ブラックロックUKエクイティ・アブソリュート・リターン・ファンド 円ヘッジクラスI投資証券

形態	ルクセンブルグ籍追加型投資信託(会社型投資信託)/円建て円ヘッジ
運用の基本方針	本ファンドは、市場動向に係わらずプラスの絶対収益の追求を目指します。
主要投資対象	英国企業、英国に主要な業務基盤がある企業または英国証券取引所を主要な取引所として上場している企業の株式もしくは株式関連の派生商品等を主要な投資対象とします。
投資態度	<p>ファンドの純資産の少なくとも70%を英国企業、英国に主要な業務基盤がある企業または英国証券取引所を主要な取引所として上場している企業の株式もしくは株式関連の派生商品等(以下、「英国関連株式等」といいます)へ投資を行います。</p> <p>英国関連株式等に投資を行い、ロング・ショート(買い建ておよび売り建て)ポジションを構築します。</p> <p>プラスの絶対収益を追求するため、デリバティブ取引を積極的に活用します。</p>

主な投資制限	同一発行体の譲渡性のある証券への投資は、原則としてファンドの純資産総額の10%以下とします。 純資産総額の5%を超えて投資しているすべての発行体について、ファンドが保有する譲渡性のある証券の総額は原則として純資産総額の40%を超えないものとします。 純資産総額の10%を超える借入れは行いません。 有価証券の空売りは行いません。
収益の分配	無し
信託期間	無期限（平成28年8月18日設定）
決算日	5月31日
管理報酬等	運用報酬：年率0.75% 運用実績報酬：ハードルレートを上回る部分につき20% 上記の他、信託財産にかかる租税、事務費用（管理事務代行会社費用、名義書換事務代行費用、信託財産の監査にかかる費用、法律顧問費用等含みます）、組入有価証券等の売買および保管にかかる費用、借入金にかかる利息等がファンドの信託財産から負担されます。
ファンドの関係法人	管理会社：ブラックロック（ルクセンブルグ）エス・エー 投資運用会社：ブラックロック・インベストメント・マネジメント（UK）リミテッド 保管会社兼管理事務代行会社：ステート・ストリート・バンク・ルクセンブルグ・エス・シー・エー 名義書換事務代行会社：J.P.モルガン・バンク・ルクセンブルグ・エス・エー

64. JPモルガン・インベストメント・ファンズ - グローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド - JPMグローバル・マクロ・オポチュニティーズ（1クラス）（円ヘッジ）

形態	ルクセンブルグ籍の外国投資証券 / 円建
運用の基本方針	主として世界の有価証券に投資し、またデリバティブ取引も利用して、ベンチマークを上回る資産の成長を目指します。
主要投資対象	世界各国の株式、債券、デリバティブ取引（通貨に係るものを含む）等

投資態度	<p>主として、世界各国の株式、債券、通貨等にデリバティブ取引も活用しながら投資し、ベンチマーク（ICEユーロLIBOR1カ月指数（円ヘッジ後））を上回る投資成果をめざします。</p> <p>グローバルなマクロ環境に関する複数の投資テーマを選定し、当該テーマに沿った投資戦略を組み合わせた運用を行ないます。また、ロング・ポジション、ショート・ポジションの両方を活用して機動的なポートフォリオの構築を行ないます。</p> <p>デリバティブ取引等を行なうことにより、ロング・ポジションとショート・ポジションの差額が外国投資法人の純資産総額を上回ることがあります。</p> <p>外国投資法人は様々な通貨建ての資産に投資することがあり、ユーロ以外の通貨建て資産については当該通貨売りユーロ買いの為替取引を行なうことがあります。また、グローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド（円ヘッジ・クラス）においては、原則としてグローバル・マクロ・オポチュニティーズ・ファンド（円ヘッジ・クラス）の純資産総額とほぼ同程度のユーロ売り円買い等の為替取引を行ない、円に対するユーロの為替変動リスクの低減を目指します。</p>
主な投資制限	<p>1企業に対する投資比率は、サブファンドの総資産額の10%以下とします。</p> <p>サブファンドの総資産額の5%を超えて投資する企業への投資比率の総計は、サブファンドの総資産額の40%以下とします。</p>
収益の分配	原則として分配を行ないません。
信託期間	無期限
決算日	毎年12月31日
管理報酬等	<p>運用報酬:0.60%</p> <p>管理手数料:上限0.11%</p> <p>ただし、この他に有価証券の売買にかかる費用・税金、臨時で発生する費用、その他の税金等が実費でかかります。</p>
ファンドの関係法人	<p>投資顧問会社: JPMorgan Asset Management (UK) Limited</p> <p>管理会社: JPMorgan Asset Management (Europe) S.à r.l.</p> <p>保管会社: J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A.</p>
ベンチマーク	ICEユーロLIBOR1カ月指数(円ヘッジ後)
ベンチマークについて	該当事項はありません。

65. イートン・ヴァンス・インターナショナル（アイルランド）グローバル・マクロ・ファンドのクラス
I 2投資証券

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	投資収益及びキャピタル・ゲインの実現を目指して運用します。

主要投資対象	世界各国の通貨、ソブリン債、クレジット・デフォルト・スワップ、金利スワップ及び先物、株式指数スワップ及び先物
投資態度	新興国、フロンティア諸国を含めたグローバル市場の通貨、金利、ソブリン・クレジット、株式に分散投資します。 世界各国に対するファンダメンタルズ分析とリスク要因分析を組み合わせたボトム・アップにより投資決定します。 投資プロセスの各段階においてリスク管理を重視し、投資目標から逸脱する可能性に備えてポートフォリオ全体のリスクを監視します。 ロングおよびショートポジションに分散投資する戦略により伝統資産との相関を抑えながら安定した収益の獲得を目指します。 デリバティブ取引を積極的に活用し投資します。
主な投資制限	通貨の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-100%～+100%を目指します。 金利の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-100%～+100%を目指します。 ソブリン・クレジットの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-100%～+100%を目指します。 株式の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%～+20%を目指します。 金融デリバティブ商品の原資産のポジション及びエクスポージャーは直接投資に起因するポジション関連と合わせてUCITS通知に規定される投資制限を超過して投資しません。 借入額がファンドの純資産総額の10%を超える借入は行いません。
収益の分配	無し
信託期間	無制限(平成28年6月7日当初設定)
決算日	12月31日
管理報酬等	運用報酬等:年率0.80% 管理報酬等:年率0.35%(上限)。但し年間60,000米ドルを最低報酬額とします。 上記の他、本ファンドの運用につき発生した一定の費用及び経費(登録費用及び各種法域における規制当局・監督当局・財務当局、運用、投資運用、事務管理、資産保管業務に関連するその他の諸費用、顧客業務手数料、目論見書・販売用資料・パンフレットその他の投資家向け書類の作成、組版及び印刷、税金及び手数料、本投資証券の発行・購入・買戻し及び償還、名義書換代理人・配当分配代理人・投資主向け業務代理人・投資証券登録機関、印刷費・輸送費・監査費・会計費・法務費用、投資主及び政府機関向け報告、投資主総会及び委任状勧誘(もしある場合)、保険料、団体及び組合費、並びに経常外及び臨時科目を含むがこれに限定されない。)も、ファンドの信託財産から負担されます。
ファンドの関係法人	投資運用会社:イートン・ヴァンス・アドバイザーズ(アイルランド)リミテッド 副投資顧問会社:イートン・ヴァンス・マネジメント 管理事務代行会社:シティバンク・ヨーロッパ・ピーエルシー 保管会社:シティバンク・インターナショナル・ピーエルシー・アイルランド支店

ベンチマーク	該当なし
ベンチマークについて	該当なし

66. ピクテ・トータル・リターン - アトラス クラスHJ JPY (円ヘッジ) 投資証券 (円建)

形態	ルクセンブルグ籍追加型投資信託(会社型投資信託)/円建て円ヘッジ
運用の基本方針	投資対象ファンドの投資目的は世界株式へのロング・ショート戦略での投資によって長期的な絶対リターンを追求し投資元本の成長を目指すことです。
主要投資対象	ファンドは主に株式、株式関連証券(普通株あるいは優先株など)、預金、マネーマーケット商品に投資します。
投資態度	伝統的なロング・ポジションに加え、金融派生商品の利用による合成(synthetic)ロング並びにショート・ポジションを取ります。 ファンドは主に株式、株式関連証券(普通株あるいは優先株など)、預金、マネーマーケット商品に投資します。 ファンドはあらゆる国(新興国を含む)、セクター、通貨に投資します。ただし、市場の状況によっては、単一国あるいは特定の国、単一セクター、単一通貨、単一資産クラスに限定して投資することがあります。
主な投資制限	ファンドは預託証券(ADR、GDR、EDR)へは無制限に投資できますが、リートへは純資産の20%まで投資することができます。 ファンドは(i)QFII枠やROFII枠(ii)上海・香港ストック・コネクトを通じて中国A株に純資産の10%まで投資することができます。また金融派生商品を使って中国A株に投資することができます。 ファンドは非投資適格証券(ディストレスト並びにデフォルト証券を含む)に純資産の10%まで投資することができます。 転換社債への投資は純資産の10%を超えることはできません。 ルール144A証券への投資は純資産の10%を超えることはできません。
収益の分配	無し
信託期間	無期限 (平成28年11月15日設定)
決算日	毎年12月31日
管理報酬等	運用報酬:0.90%(2017年1月末現在、上限1.40%) 管理報酬等:サービス手数料 0.32%(2017年1月末現在、上限0.40%)、受託銀行手数料 0.04%(2017年1月末現在、上限0.22%) 成功報酬:ハードルレートであるLIBOR JPY Spot Next超過分の20% 上記の他、信託財産にかかる租税、組入有価証券等の売買・保管にかかる費用、現地登録代行・名義書換事務代行・管理事務代行にかかる費用、海外の代行報酬、目論見書等の作成等費用、当局および取引所への登録等費用、定期の報告書その他法定の書面の作成等費用、純資産価額の計算費用、受益者への報告書の作成等費用、法律顧問費用、信託財産の監査費用、広告費用が含まれます。

ファンドの 関係法人	管理会社：ピクテ・アセット・マネジメント(ヨーロッパ)エス・エイ 投資顧問会社：ピクテ・アセット・マネジメント・エス・エイ、ピクテ・アセット・マネジメント・リミテッド 保管会社・管理事務代行会社：BNP パリバ・セキュリティ・サービス、ルクセンブルグ・ブラン チ 名義書換事務代行会社・支払事務代行会社：ファンドパートナー・ソリューションズ(ヨーロッパ)エ ス・エイ
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・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

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・ピー・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・アセット・マネジメント株式会社

平成16年 4月 8日	マニユライフ・アセット・マネジメント株式会社設立
平成17年10月 7日	社団法人日本投資顧問業協会 加入
平成19年 9月30日	投資運用業、投資助言・代理業登録
平成28年 4月28日	第二種金融商品取引業登録
平成28年 7月 1日	マニユライフ・インベストメンツ・ジャパン株式会社と合併、一般社団法人投資信託協会加入

平成24年7月2日付けで一般社団法人日本投資顧問業協会に変更になっています。

M F S インベストメント・マネジメント株式会社

平成10年 5月12日	マサチューセッツ・インベストメント・マネジメント株式会社設立
平成10年 6月30日	投資顧問業の登録
平成11年 2月18日	投資一任契約に係る業務の認可
平成11年12月 9日	証券投資信託委託業の認可
平成12年 8月 1日	エムエフエス・インベストメント・マネジメント株式会社に商号変更
平成19年 9月30日	金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業（投資助言・代理業、投資運用業）のみなし登録
平成23年 6月22日	M F S インベストメント・マネジメント株式会社に商号変更

ウエリントン・マネージメント・カンパニー・エルエルピー

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

アセットマネジメントOne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
平成28年10月1日	D I A Mアセットマネジメント株式会社、みずほ投信投資顧問株式会社、新光投信株式会社、みずほ信託銀行株式会社(資産運用部門)が統合し、商号をアセットマネジメントOne株式会社に変更

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 ブリンソン・パートナーズ投資顧問株式会社と合併し、安田火災ブ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
- 平成25年 3月28日 米国The TCW Group, Inc.との資本提携を解消
- 平成28年 12月9日 確定拠出年金運営管理業の登録

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B N Yメロン・アセット・マネジメント・ジャパン株式会社に変更

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

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

野村アセットマネジメント株式会社

昭和34年（1959年）12月 1日 野村証券投資信託委託株式会社として設立
平成 9年（1997年）10月 1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更
平成12年（2000年）11月 1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更
平成15年（2003年）6月27日 委員会等設置会社へ移行

バリュートナーズ

1993年

- バリュートナーズが香港にて設立される
- 旗艦のClassicファンドを設定

1998年

- マニユライフとの提携を開始し、2006年以降で香港最大の積立強制基金(MPF)の運用を支援

2002年

•高配当株式ファンドを設定

2007年

•バリュース・パートナーズグループ・リミテッドが香港証券取引所のメインボードに上場

2008年

•HSBCが当社の販売パートナーに

2009年

•中国および海外市場でのプレゼンス確立を開始

2012年

•グループ初の債券リテールファンドを設定

2013年

•中国最大の銀行である中国工商銀行との提携開始

2014年

•シンガポールオフィスを設立し、東南アジアに進出

2015年

•QDLPライセンス(適格国内有限責任投資組合)を取得し、中国での私募ファンド事業を拡大

2016年

•バリュース・パートナーズ・ロンドンオフィス・オープン

FILファンド・マネジメント・リミテッド（バミューダ）

（同社を100%保有するFILリミテッドの沿革）

- 1969年 フィデリティ・インターナショナルの前身が設立され、初の海外拠点として東京にオフィスを開設。
- 1973年 ロンドンにオフィスを開設。
- 1980年 フィデリティ・インターナショナルが設立される。
- 1981年 香港にオフィスを開設。
- 1990年 欧州およびアジア市場向けに17本の外国籍投信（ルクセンブルグ籍）を設定・提供開始。

- 1994年 英国で確定拠出年金ビジネスの提供を開始。
 2000年 アラブ首長国連邦、韓国、イタリアにオフィスを開設。
 2004年 上海にオフィスを開設。
 2013年 マルチ・アセット運用を担当するフィデリティ・マルチ・アセット始動。

ブラックロック

（海外法人に関しては、全てブラックロック全体として記載しております。）

1988	BlackRock設立
1995	PNC傘下の債券運用会社となる
1996	PNCのオープン・エンド型投信の運用を担当
1998	PNC傘下の株式、債券、流動性資産及びミューチュアル・ファンド運用をBlackRockの下に統合
1999	ニューヨーク証券取引所において新規株式公開を実現し、PNCが主要株主となる
2000	"BlackRock Solutions"ブランドを立ち上げ、リスク・マネジメント及びテクノロジー・サービスの提供を開始
2005	1月31日 State Street Research and Management及びSSR Realtyを買収
2006	9月29日（日本は10月2日）Merrill Lynch Investment Managersと経営統合
2007	10月1日 Quellos Group, LLC よりファンド・オブ・ファンズ・ビジネスを買収
2008	BlackRock Solutions部門にてフィナンシャル・マーケット・アドバイザー・ビジネスを立ち上げ
2009	1月1日 Bank of AmericaによるMerrill Lynch買収完了 5月 R3 Capital Partnersより29名の運用プロフェッショナルを採用 12月1日（日本は12月2日）Barclays Global Investors (BGI)と経営統合
2013	10月4日 MGPA (独立系プライベート・エクイティ不動産投資アドバイザー)を買収

JPモルガン・アセット・マネジメント (UK) リミテッド

（同社が所属するJ.P.モルガン・アセット・マネジメント*の沿革を記載致します。）

- 1799年 ザ・バンク・オブ・マンハッタン・カンパニーを設立（チェース・マンハッタン銀行の前身）
 1830年 JPモルガンの基礎が築かれる

- 1868年 Sessions and Co.を設立（バンク・ワンの前身）
- 2000年 ザ・チェース・マンハッタン・コーポレーションがJPモルガン・アンド・カンパニー・インコーポレーテッドと合併。持株会社J.P.モルガン・チェース・アンド・カンパニーが誕生。
- 2004年 JPモルガン・チェース・アンド・カンパニーとバンクワン・コーポレーションが合併
- 2005年 その傘下の資産運用部門J.P.モルガン・アセット・マネジメントが誕生

*「J.P.モルガン・アセット・マネジメント」は、JPモルガン・チェース・アンド・カンパニーおよび世界の関連会社の資産運用ビジネスのブランドです。

イートン・ヴァンス・マネジメント

- 1979年 イートン&ハワード社とヴァンス、サンダース&カンパニー社との合併により設立
- 1982年 ハイ・イールド債戦略を導入
- 1989年 最初のバンクローン戦略ファンドを設定
- 1990年 新興国債ファンドを設定
- 1996年 ニューヨーク証券取引所上場
- 2015年 国連責任投資原則に署名

モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社

- 昭和62年2月 モルガン・スタンレー投資顧問株式会社設立
- 昭和62年3月 投資顧問業登録
- 昭和62年9月 投資一任業務認可
- 平成7年9月 投資信託委託業務の免許取得
- 平成24年4月 モルガン・スタンレー・インベストメント・マネジメント株式会社に商号を変更

UBSアセット・マネジメント株式会社

平成 8年 4月ユー・ビー・エス投資顧問株式会社設立

平成 8年 5月投資顧問業者として登録

平成 8年 8月投資一任業務認可取得

平成10年 4月ユー・ビー・エス投信投資顧問株式会社に商号変更

平成10年 5月証券投資信託委託業務免許取得

平成12年 7月ユービーエス・プリンソン投資顧問株式会社と合併し、ユービーエス・アセット・マネジメント株式会社に商号変更

平成14年 4月ユービーエス・グローバル・アセット・マネジメント株式会社に商号変更

平成27年12月UBSアセット・マネジメント株式会社に商号変更

日興アセットマネジメント株式会社

昭和34年12月日興証券投資信託委託株式会社として設立

昭和35年4月営業開始

平成11年4月 日興国際投資顧問株式会社と合併し「日興アセットマネジメント株式会社」に社名変更

平成21年10月住友信託銀行株式会社（現三井住友信託銀行株式会社）が当社株式の98.54%を取得

ピクテ・アセット・マネジメント・エス・エイ

2005年 8月ピクテ・アセット・マネジメント・エス・エイに設立（スイス、ジュネーブ）

2005年11月 F I N M A（スイス連邦金融市場監督機構、旧スイス銀行監督委員会）登録

2006年 1月 1967年以来、グループ会社であるピクテ・アンド・シー・エス・エイが行ってきたスイス機関投資家向け資産運用ビジネスを移管

2006年 6月 S E C（米国証券取引委員会）登録

2015年 4月組織再編によりピクテ・ファンド・エス・エイ（1996年設立、スイス投資信託運用会社）とピクテ・アセット・マネジメント・エス・エイが合併。存続会社であるピクテ・

ファンド・エス・エイの社名をピクテ・アセット・マネジメント・エス・エイに変更。

ピクテ・アセット・マネジメント・リミテッド

1995年8月ピクテ・インターナショナル・マネジメント（SEC）リミテッド設立（英国ロンドン）

1995年9月IMRO（英国投資顧問規制機構）登録

1996年12月ピクテ・インターナショナル・マネジメント・リミテッドに社名変更

2001年12月FSA（英国金融サービス機構、現FCA（英国金融行為規制機構））登録

2006年1月ピクテグループ組織再編によりピクテ・アセット・マネジメントUK（オールドPAM）
LTD（1980年米国SEC登録運用会社）の全ての業務をピクテ・インターナショナル・
マネジメント・リミテッドに譲渡。

同社はピクテ・アセット・マネジメント・リミテッドに社名変更

3 【投資リスク】

<更新後>

(1) 価額変動リスク

<略>

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

<略>

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

〈金利変動による価格変化のイメージ図〉



※上図はイメージ図であり、当ファンドの運用成果を表すものではありません。

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が債務不履行を発生させた場合、またはその可能性が予想される場合には、公社債の価格は下落します。ハイ・イールド債については、格付けの高い公社債に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。組入公社債の価格が下落した場合には、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。

転換社債の価格は、転換対象とする株式等の価格変動や金利変動等の影響を受けて変動します。転換社債の市場は、上場株式等の市場と比較して一般に市場規模や取引量が小さく、流動性が低いことにより本来想定される投資価値とは乖離した価格水準で取引される場合もあるなど、価格変動が大きくなる傾向があると考えられます。転換社債の価格は、発行企業の信用状況によっても変動します。特に、発行企業が債務不履行を発生させた場合、またはその可能性が予想される場合には、転換社債の価格は下落します。格付けの低い、および格付けの無い転換社債は、格付けが高い転換社債と比較して、一般に債務不履行が生じるリスクが高いと考えられます。

< 略 >

運用手法にかかるリスク・留意点

< 略 >

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

- ・ロング・ショート戦略では、投資対象市場の動向による影響を受けにくい運用をめざしますが、その影響を全て排除できるわけではありません。
- ・投資対象市場やロング(買建て)・ショート(売建て)戦略により保有する株式などの値動きの見通しが予測と異なった場合は、基準価額の下落要因になります。
- ・ただし、レバレッジを活用して取引を行なう場合には、投資対象の市場における値動きに比べて大きな損失が生じる可能性があります。

< 略 >

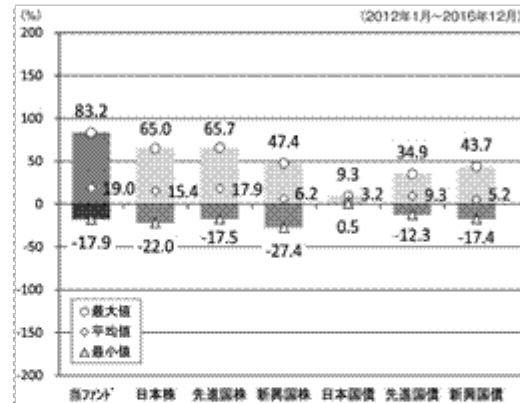
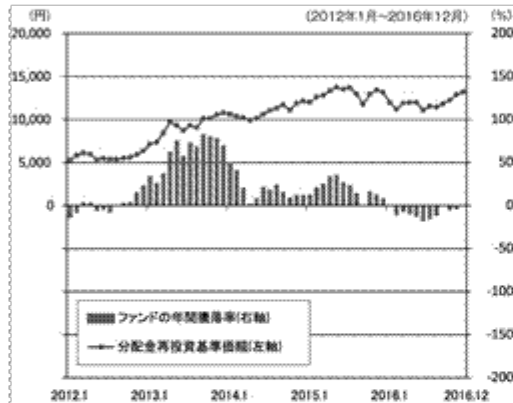
参考情報

●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年間に於ける年間騰落率（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年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

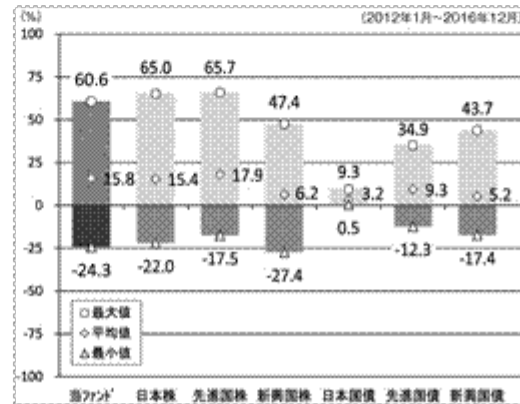
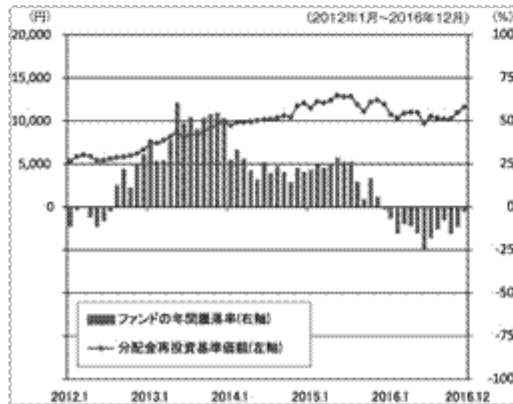
ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

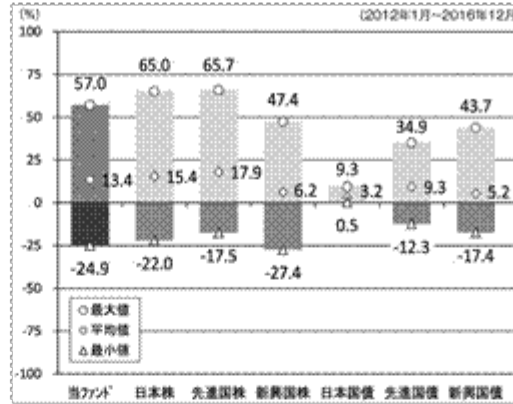
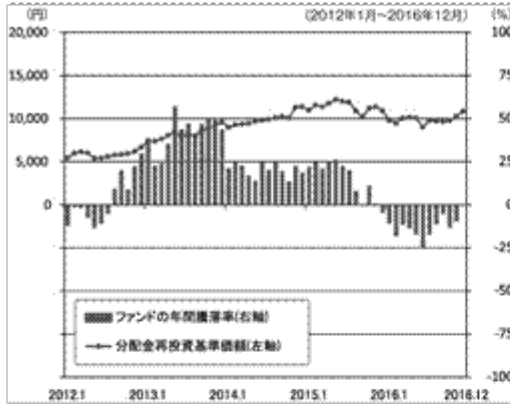
[ダイワファンドラップ 日本株式セレクト]



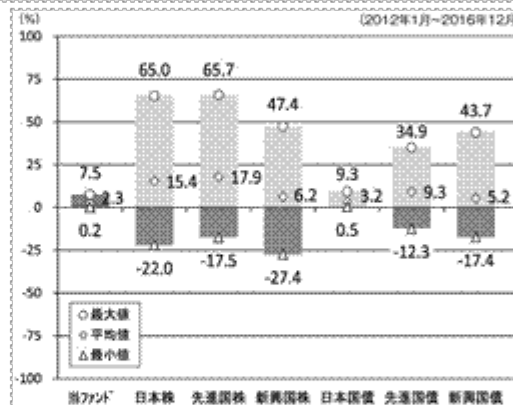
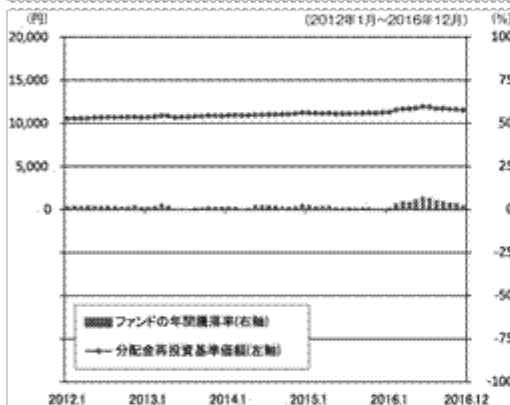
[ダイワファンドラップ 外国株式セレクト]



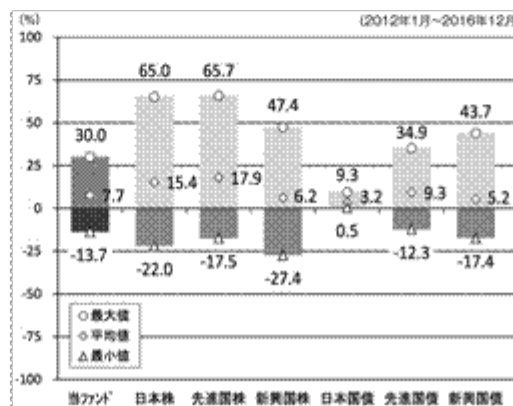
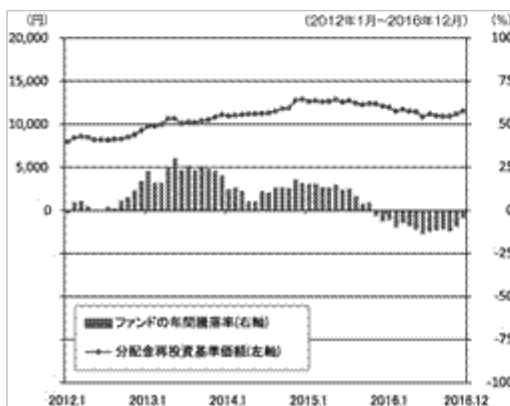
【ダイワファンドラップ 外国株式セレクト エマージングプラス】



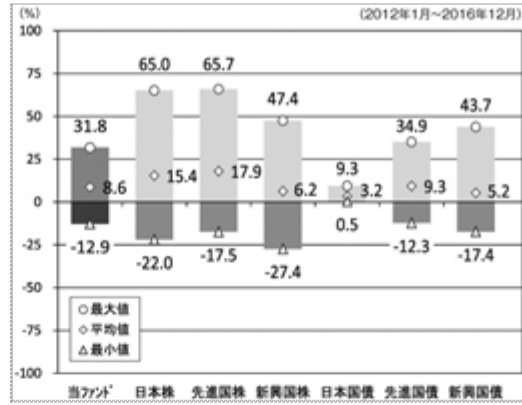
【ダイワファンドラップ 日本債券セレクト】



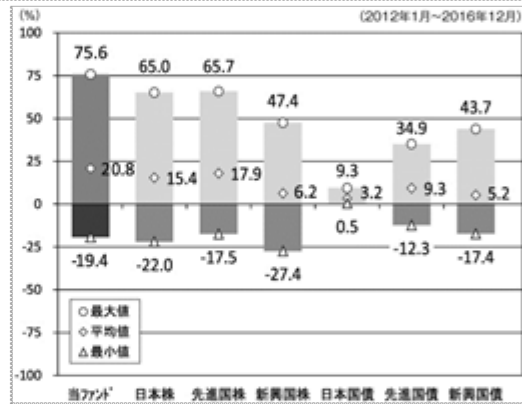
【ダイワファンドラップ 外国債券セレクト】



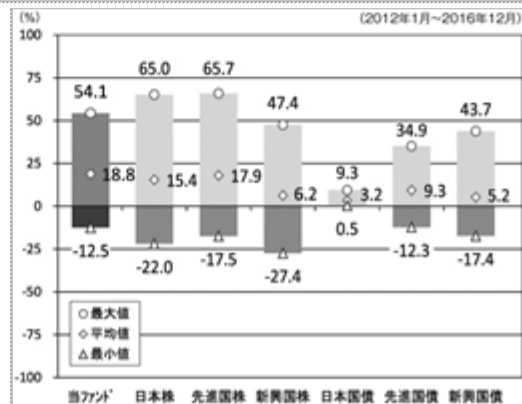
【ダイワファンドラップ 外国債券セレクト エマージングプラス】



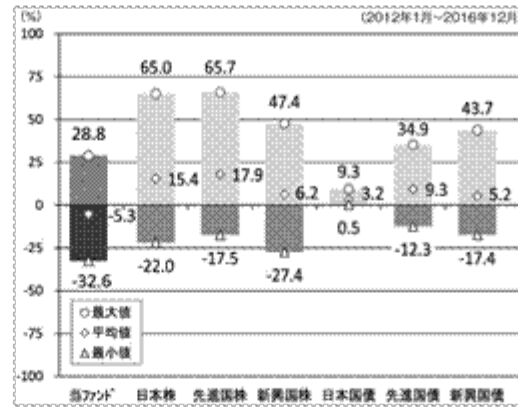
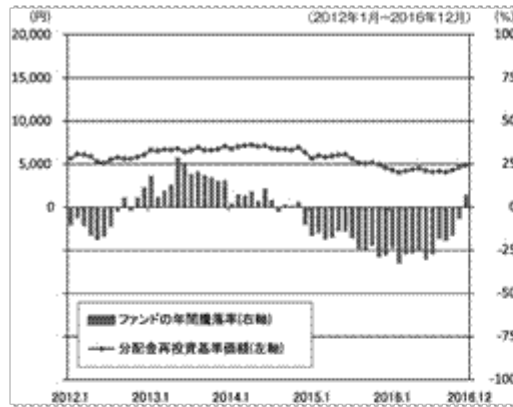
【ダイワファンドラップ J-REITセレクト】



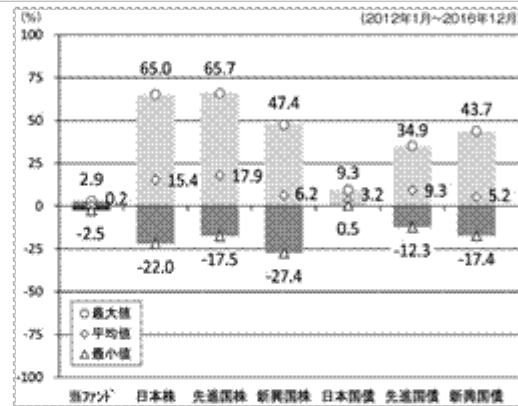
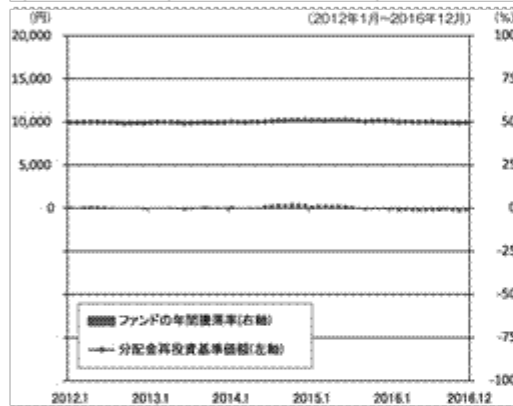
【ダイワファンドラップ 外国REITセレクト】



【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禁止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證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證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、

4 【手数料等及び税金】

(3) 【信託報酬等】

< 更新後 >

< 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29年2月時点）	
FW日本株式セレクト	1.017 ± 0.29%程度
FW外国株式セレクト	1.364 ± 0.59%程度
FW外国株式EM+	1.393 ± 0.45%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 0.435 ± 0.05%程度 1%以上2%未満の場合 0.492 ± 0.07%程度
FW外国債券セレクト	0.955 ± 0.18%程度
FW外国債券EM+	0.981 ± 0.20%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	1.274 ± 0.39%程度

< 略 >

(5) 【課税上の取扱い】

< 更新後 >

< 略 >

() 上記は、平成28年12月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

< 略 >

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28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	263,627,203,855	99.07
内 日本	263,627,203,855	99.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,461,900,337	0.93
純資産総額	266,089,104,192	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28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・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	53,565,042,767	0.8330 44,619,982,626	1.0270 55,011,298,921	20.67
2	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	41,705,931,675	0.9325 38,891,029,656	1.0747 44,821,364,771	16.84
3	ダイワ・バリュー株・オープン	日本	投資信託 受益証券	38,416,132,159	0.8695 33,402,884,371	1.0288 39,522,516,765	14.85
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	34,869,600,817	0.9036 31,509,353,244	1.0596 36,947,829,025	13.89
5	GIM日本株・ファンド	日本	投資信託 受益証券	11,967,923,347	0.9331 11,168,406,918	1.1005 13,170,699,643	4.95
6	J Flag 中小型株ファンド	日本	投資信託 受益証券	2,904,779,875	3.6559 10,619,773,370	3.6851 10,704,404,317	4.02
7	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	6,016,866,452	1.0984 6,609,265,694	1.3262 7,979,568,288	3.00
8	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	6,739,533,058	0.8928 6,017,183,604	1.1822 7,967,475,981	2.99
9	日本小型株フォーカス・ファンド	日本	投資信託 受益証券	7,083,662,852	1.0078 7,139,168,967	1.1216 7,945,036,254	2.99
10	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	4,882,737,423	1.5134 7,389,579,311	1.6265 7,941,772,418	2.98
11	ダイワ成長株オープン	日本	投資信託 受益証券	7,102,664,548	1.0065 7,149,423,623	1.1143 7,914,499,105	2.97

12	ニッセイJPX日経400アクティブファン ド	日本	投資信託 受益証券	7,147,545,847	1.0172 7,270,514,585	1.1066 7,909,474,234	2.97
13	リサーチ・アクティブ・オープンF	日本	投資信託 受益証券	410,000	17,061 6,995,109,680	19,272 7,901,520,000	2.97
14	ダイワ好配当日本株投信Q	日本	投資信託 受益証券	6,856,473,567	0.9965 6,832,514,196	1.1507 7,889,744,133	2.97

(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	99.07%
合計	99.07%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	9,600,709,041	9,600,709,041	0.8635	0.8635
第2計算期間末 (平成21年6月15日)	11,860,164,259	11,860,164,259	0.6103	0.6103
第3計算期間末 (平成22年6月15日)	19,207,909,959	19,207,909,959	0.5829	0.5829
第4計算期間末 (平成23年6月15日)	20,490,790,512	20,490,790,512	0.5681	0.5681
第5計算期間末 (平成24年6月15日)	18,780,690,683	18,780,690,683	0.5246	0.5246
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
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
平成27年12月末日	252,268,087,475	-	1.3141	-
平成28年1月末日	232,872,329,754	-	1.1953	-
2月末日	216,647,990,321	-	1.1159	-

3月末日	235,122,270,364	-	1.1875	-
4月末日	239,591,926,369	-	1.1978	-
5月末日	240,674,399,927	-	1.1980	-
第9計算期間末 (平成28年6月15日)	226,681,824,888	226,681,824,888	1.1256	1.1256
6月末日	224,220,179,832	-	1.1093	-
7月末日	240,708,954,148	-	1.1536	-
8月末日	240,407,837,530	-	1.1437	-
9月末日	250,594,758,847	-	1.1837	-
10月末日	255,146,131,310	-	1.2263	-
11月末日	263,738,578,149	-	1.2862	-
12月末日	266,089,104,192	-	1.3213	-

【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
第9計算期間	0.0000
平成28年6月16日～ 平成28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
第9計算期間	17.8
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	18.4

(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	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
第9計算期間	80,718,816,346	37,624,796,734
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	29,073,480,607	27,776,543,242

(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28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	155,766,259,344	90.47
内 日本	152,419,572,971	88.53
内 香港	3,346,686,373	1.94
投資証券	13,354,693,012	7.76
内 アイルランド	13,354,693,012	7.76
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,046,825,623	1.77
純資産総額	172,167,777,979	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28年12月30日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	MFS外国株コア・ファンド	日本	投資信託 受益証券	21,021,696,763	1.9065 40,078,075,258	2.1743 45,707,475,271	26.55
2	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	33,259,021,624	1.0335 34,375,149,567	1.1653 38,756,737,898	22.51
3	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	24,763,677,802	0.9055 22,424,258,528	1.0248 25,377,817,011	14.74
4	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	16,491,677,414	0.9681 15,967,032,153	1.0462 17,253,592,910	10.02
5	LAZARD US EQUITY CONCENTRATED FUND INSTITUTIONAL ACCUMULATING YEN CLASS	アイルラン ド	投資証券	1,183,292.49	10,056.68 11,900,000,000	11,286.04 13,354,693,012	7.76
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	10,076,450,905	0.8536 8,601,474,869	0.9965 10,041,183,326	5.83
7	ニッセイ米国配当成長株ファンド	日本	投資信託 受益証券	6,729,406,336	1.0821 7,282,342,727	1.2554 8,448,096,714	4.91

8	T.R.P欧州株式オープン	日本	投資信託 受益証券	5,448,872,692	0.8988 4,897,481,000	0.9447 5,147,550,032	2.99
9	VALUE PARTNERS HIGH DIVIDEND STOCKS FUND CLASS A1 USD	香港	投資信託 受益証券	403,956.52	8,708.79 3,517,998,000	8,284.76 3,346,686,373	1.94
10	ダイワ・アジア・オセアニア先進国株式 ファンド	日本	投資信託 受益証券	1,484,226,101	0.9843 1,460,960,023	1.1367 1,687,119,809	0.98

(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	90.47%
投資証券	7.76%
合計	98.23%

(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
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
平成27年12月末日	158,846,105,335	-	1.1924	-
平成28年1月末日	146,014,520,196	-	1.0713	-

2月末日	141,817,392,047	-	1.0345	-
3月末日	154,479,855,642	-	1.0873	-
4月末日	156,185,925,159	-	1.0990	-
5月末日	156,673,858,951	-	1.0968	-
第9計算期間末 (平成28年6月15日)	148,029,722,000	148,029,722,000	1.0318	1.0318
6月末日	139,411,223,663	-	0.9669	-
7月末日	157,807,501,163	-	1.0522	-
8月末日	155,972,365,490	-	1.0317	-
9月末日	155,348,749,811	-	1.0201	-
10月末日	154,363,936,632	-	1.0261	-
11月末日	163,741,821,640	-	1.0945	-
12月末日	172,167,777,979	-	1.1581	-

【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
第9計算期間	0.0000
平成28年6月16日～ 平成28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
第9計算期間	19.6
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	11.9

(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	4,118,537,390	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
第9計算期間	68,393,821,683	30,209,487,179
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	23,853,496,605	19,206,981,342

(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28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	92,877,294,251	77.63
内 日本	90,926,712,793	76.00
内 香港	1,950,581,458	1.63
投資証券	25,797,904,970	21.56
内 アイルランド	22,276,491,970	18.62
内 ルクセンブルグ	3,521,413,000	2.94
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	964,671,929	0.81
純資産総額	119,639,871,150	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28年12月30日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	MFS外国株コア・ファンド	日本	投資信託 受益証券	11,772,923,483	1.8989 22,355,903,136	2.1743 25,597,867,529	21.40
2	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	18,623,219,953	1.0313 19,207,116,705	1.1653 21,701,638,211	18.14
3	LAZARD GL ACTIVE-EM MK EQ	アイルラ ンド	投資証券	1,199,270.05	11,171.04 13,397,207,800	12,204.94 14,637,029,190	12.23
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	13,802,830,494	0.9056 12,500,332,975	1.0248 14,145,140,690	11.82
5	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	9,167,744,264	0.9690 8,884,442,536	1.0462 9,591,294,048	8.02
6	LAZARD US EQUITY CONCENTRATED FUND INSTITUTIONAL ACCUMULATING YEN CLASS	アイルラ ンド	投資証券	676,894.55	10,045.87 6,800,000,000	11,286.04 7,639,462,780	6.39

7	ダイワ新興国株式ファンド	日本	投資信託 受益証券	6,440,177,316	0.7615 4,904,363,342	0.8947 5,762,026,644	4.82
8	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	日本	投資信託 受益証券	5,654,614,202	0.8541 4,829,843,708	0.9965 5,634,823,052	4.71
9	ニッセイ米国配当成長株ファンド	日本	投資信託 受益証券	3,731,265,393	1.0827 4,039,915,755	1.2554 4,684,230,574	3.92
10	FIDELITY FUNDS - INSTITUTIONAL EMERGING MARKETS EQUITY FUND I-ACC-JPY	ルクセンブ ルグ	投資証券	3,325,224.74	992.41 3,300,000,000	1,059.00 3,521,413,000	2.94
11	T.R.P欧州株式オープン	日本	投資信託 受益証券	3,036,789,080	0.9000 2,733,418,258	0.9447 2,868,854,643	2.40
12	VALUE PARTNERS HIGH DIVIDEND STOCKS FUND CLASS A1 USD	香港	投資信託 受益証券	235,441.87	8,707.97 2,050,224,000	8,284.76 1,950,581,458	1.63
13	ダイワ・アジア・オセアニア先進国株式 ファンド	日本	投資信託 受益証券	827,691,917	0.9794 810,641,465	1.1367 940,837,402	0.79

(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	77.63%
投資証券	21.56%
合計	99.19%

(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
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
平成27年12月末日	125,014,788,823	-	1.0874	-
平成28年1月末日	113,265,959,542	-	0.9775	-
2月末日	109,996,912,215	-	0.9456	-
3月末日	117,462,647,350	-	1.0044	-
4月末日	117,891,902,028	-	1.0151	-
5月末日	116,836,632,337	-	1.0070	-
第9計算期間末 (平成28年6月15日)	110,381,316,788	110,381,316,788	0.9517	0.9517
6月末日	104,309,299,894	-	0.8990	-
7月末日	115,216,933,276	-	0.9816	-
8月末日	113,467,256,418	-	0.9679	-
9月末日	113,099,195,792	-	0.9616	-
10月末日	111,623,748,582	-	0.9725	-
11月末日	115,923,215,884	-	1.0274	-
12月末日	119,639,871,150	-	1.0833	-

【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
第9計算期間	0.0000
平成28年6月16日～ 平成28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
第9計算期間	20.9

平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	14.0
----------------------------	------

(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	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
第9計算期間	36,498,306,299	20,142,862,575
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	9,338,979,599	14,165,504,239

(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28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	401,274,800,123	99.31
内 日本	401,274,800,123	99.31
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,805,850,809	0.69
純資産総額	404,080,650,932	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28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・ダイナミック日本債券ファンド	日本	投資信託 受益証券	99,360,709,497	1.0818 107,490,379,182	1.0498 104,308,872,829	25.81
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	91,719,870,961	1.0734 98,455,712,554	1.0500 96,305,864,509	23.83
3	ダイワ日本国債ファンド - ラダー2 0 -	日本	投資信託 受益証券	80,631,107,793	1.0141 81,773,573,403	0.9953 80,252,141,586	19.86
4	NN国内債券ファンド	日本	投資信託 受益証券	52,001,582,022	1.0201 53,048,661,843	1.0020 52,105,585,186	12.89
5	マニュアル日本債券アクティブ・ ファンドM	日本	投資信託 受益証券	34,796,484,312	1.1813 41,105,538,057	1.1534 40,134,265,005	9.93

6	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	15,911,728,040	1.0245 16,301,930,475	1.0141 16,136,083,405	3.99
7	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	11,627,355,628	1.0664 12,399,588,082	1.0348 12,031,987,603	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	99.31%
合計	99.31%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	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
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
平成27年12月末日	427,454,516,807	-	1.1231	-
平成28年1月末日	433,327,635,024	-	1.1276	-
2月末日	440,369,585,518	-	1.1522	-
3月末日	434,222,938,131	-	1.1654	-

4月末日	428,105,794,397	-	1.1678	-
5月末日	430,418,524,846	-	1.1740	-
第9計算期間末 (平成28年6月15日)	432,643,794,048	432,643,794,048	1.1820	1.1820
6月末日	437,151,958,706	-	1.1924	-
7月末日	422,685,478,977	-	1.1869	-
8月末日	419,425,632,625	-	1.1703	-
9月末日	421,096,357,555	-	1.1696	-
10月末日	414,677,706,736	-	1.1646	-
11月末日	410,127,039,539	-	1.1586	-
12月末日	404,080,650,932	-	1.1514	-

【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
第9計算期間	0.0000
平成28年6月16日～ 平成28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
第9計算期間	7.1
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	2.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	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
第9計算期間	138,213,194,615	93,918,586,974
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	44,710,888,531	58,426,897,946

(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28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	101,383,850,142	95.92
内 日本	56,150,191,952	53.13
内 ケイマン諸島	45,233,658,190	42.80
投資証券	3,424,969,166	3.24
内 アイルランド	3,424,969,166	3.24
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	884,283,904	0.84
純資産総額	105,693,103,212	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28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	ベアリング外国債券ファンドM	日本	投資信託 受益証券	28,854,995,857	0.9077 26,194,528,640	0.9030 26,056,061,258	24.65
2	GLOBAL CORE BOND FUND EX-JAPAN	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	1,630,019.48	9,130.80 14,883,395,907	9,680.00 15,778,588,566	14.93
3	INVESTMENT GRADE EURO AGGREGATE BOND SUB-TRUST	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	1,447,508	9,627.53 13,935,937,841	10,222.22 14,796,753,334	14.00
4	WELLINGTON GLOBAL AGGREGATE NON YEN BOND FUND CLASS S	ケイマン諸島	投資信託 受益証券	1,564,054.24	8,822.23 13,798,447,793	9,372.00 14,658,316,290	13.87
5	ダイワ米国債券ファンド	日本	投資信託 受益証券	12,518,679,549	0.9695 12,137,075,220	0.9960 12,468,604,830	11.80
6	ダイワ欧州債券ファンド	日本	投資信託 受益証券	9,450,333,855	0.9944 9,398,321,324	0.9956 9,408,752,386	8.90
7	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	5,688,617,131	1.0360 5,893,847,777	1.0821 6,155,652,597	5.82
8	GLOBAL HIGH YLD PORT2	アイルランド	投資証券	318,569.33	10,343.96 3,295,269,224	10,751.09 3,424,969,166	3.24

9	ダイワノデカ欧州債券アクティブ・ファンド	日本	投資信託 受益証券	1,986,622,536	0.9997 1,986,167,770	1.0375 2,061,120,881	1.95
---	----------------------	----	--------------	---------------	-------------------------	-------------------------	------

(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%
投資証券	3.24%
合計	99.16%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	2,192,244,689	2,192,244,689	0.9899	0.9899
第2計算期間末 (平成21年6月15日)	4,567,202,069	4,567,202,069	0.8838	0.8838
第3計算期間末 (平成22年6月15日)	7,061,149,675	7,061,149,675	0.8419	0.8419
第4計算期間末 (平成23年6月15日)	7,815,585,200	7,815,585,200	0.8180	0.8180
第5計算期間末 (平成24年6月15日)	6,753,027,786	6,753,027,786	0.8158	0.8158
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
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
平成27年12月末日	102,141,821,897	-	1.1962	-
平成28年1月末日	102,639,209,327	-	1.1811	-
2月末日	99,582,011,316	-	1.1385	-
3月末日	103,838,793,625	-	1.1597	-
4月末日	101,838,119,109	-	1.1377	-

5月末日	102,113,050,590	-	1.1321	-
第9計算期間末 (平成28年6月15日)	99,992,733,039	99,992,733,039	1.1052	1.1052
6月末日	97,587,596,226	-	1.0731	-
7月末日	102,994,049,049	-	1.1055	-
8月末日	102,822,226,466	-	1.0890	-
9月末日	102,926,225,576	-	1.0799	-
10月末日	101,782,869,319	-	1.0794	-
11月末日	103,561,538,373	-	1.1072	-
12月末日	105,693,103,212	-	1.1413	-

【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
第9計算期間	0.0000
平成28年6月16日～ 平成28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
第9計算期間	12.3
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	2.5

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	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
第9計算期間	37,342,200,145	14,200,272,642
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	13,701,557,535	11,290,308,155

(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28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	45,944,255,032	96.52
内 日本	23,859,785,136	50.12
内 ケイマン諸島	22,084,469,896	46.39
投資証券	1,279,125,341	2.69
内 アイルランド	1,279,125,341	2.69
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	379,566,875	0.80
純資産総額	47,602,947,248	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28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	ベアリング外国債券ファンドM	日本	投資信託 受益証券	10,327,656,581	0.9076 9,374,386,963	0.9030 9,325,873,892	19.59
2	EMERGING MARKET DEBT FUND	ケイマン諸 島	投資信託 受益証券	522,385.65	9,834.69 5,137,505,814	11,060.00 5,777,585,289	12.14
3	GLOBAL CORE BOND FUND EX- JAPAN	ケイマン諸 島	投資信託 受益証券	589,175.24	9,132.38 5,380,576,305	9,680.00 5,703,216,323	11.98
4	INVESTMENT GRADE EURO AGGREGATE BOND SUB-TRUST	ケイマン諸 島	投資信託 受益証券	520,728	9,625.39 5,012,212,296	10,222.22 5,322,999,092	11.18
5	WELLINGTON GLOBAL AGGREGATE NON YEN BOND FUND CLASS S	ケイマン諸 島	投資信託 受益証券	563,451.69	8,814.85 4,966,744,220	9,372.00 5,280,669,192	11.09
6	ダイワ米国債券ファンド	日本	投資信託 受益証券	4,489,134,475	0.9692 4,351,230,896	0.9960 4,471,177,937	9.39
7	ダイワ欧州債券ファンド	日本	投資信託 受益証券	3,347,227,986	0.9958 3,333,343,419	0.9956 3,332,500,182	7.00
8	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	2,103,113,588	1.0457 2,199,235,648	1.1187 2,352,753,170	4.94
9	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	2,051,880,204	1.0358 2,125,537,084	1.0821 2,220,339,568	4.66

10	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	1,393,011,364	0.9107 1,268,734,292	1.0069 1,402,623,142	2.95
11	GLOBAL HIGH YLD PORT2	アイルランド	投資証券	118,976.28	10,343.96 1,230,686,225	10,751.09 1,279,125,341	2.69
12	ダイワノデカ欧州債券アクティブ・ファンド	日本	投資信託 受益証券	727,245,538	1.0023 728,946,637	1.0375 754,517,245	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	96.52%
投資証券	2.69%
合計	99.20%

(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
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
平成27年12月末日	51,351,641,085	-	1.2643	-
平成28年1月末日	50,862,271,771	-	1.2460	-

2月末日	48,857,564,370	-	1.2025	-
3月末日	49,812,466,273	-	1.2269	-
4月末日	48,976,818,195	-	1.2099	-
5月末日	48,765,225,013	-	1.2041	-
第9計算期間末 (平成28年6月15日)	47,631,057,753	47,631,057,753	1.1743	1.1743
6月末日	46,386,822,977	-	1.1436	-
7月末日	47,494,084,378	-	1.1811	-
8月末日	47,145,207,446	-	1.1670	-
9月末日	47,054,090,232	-	1.1574	-
10月末日	46,208,710,287	-	1.1621	-
11月末日	46,666,969,203	-	1.1908	-
12月末日	47,602,947,248	-	1.2331	-

【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
第9計算期間	0.0000
平成28年6月16日～ 平成28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
第9計算期間	11.5
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	4.0

(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	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
第9計算期間	11,028,526,492	6,666,717,748
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	3,414,923,059	5,233,324,752

(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28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	71,369,211,571	99.97
内 日本	71,369,211,571	99.97
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	18,289,726	0.03
純資産総額	71,387,501,297	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28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	28,941,286,120	2.3970 69,372,899,582	2.4660 71,369,211,571	99.97

(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	99.97%
合計	99.97%

(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)	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
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
平成27年12月末日	70,301,982,043	-	1.5194	-
平成28年1月末日	72,027,760,180	-	1.5492	-
2月末日	75,448,043,600	-	1.6327	-
3月末日	75,050,638,443	-	1.6592	-
4月末日	74,862,228,465	-	1.6845	-
5月末日	73,813,267,260	-	1.6623	-
第9計算期間末 (平成28年6月15日)	72,161,929,742	72,161,929,742	1.6252	1.6252
6月末日	72,366,279,724	-	1.6264	-
7月末日	71,103,657,702	-	1.6452	-
8月末日	70,518,323,249	-	1.6198	-
9月末日	71,237,723,998	-	1.6249	-
10月末日	69,102,078,770	-	1.5916	-
11月末日	69,283,569,903	-	1.6048	-
12月末日	71,387,501,297	-	1.6648	-

【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
第9計算期間	0.0000
平成28年6月16日～ 平成28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
第9計算期間	5.3
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	1.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	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
第9計算期間	15,995,717,433	12,193,838,641
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	5,411,089,659	6,754,187,726

(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28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	77,614,940,000	97.60
内 日本	77,614,940,000	97.60
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,907,115,081	2.40
純資産総額	79,522,055,081	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28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	9,300	582,000.00 5,412,600,000	637,000.00 5,924,100,000	7.45
2	日本ビルファンド	日本	投資証券	8,500	595,000.00 5,057,500,000	647,000.00 5,499,500,000	6.92
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	27,000	167,700.00 4,527,900,000	176,800.00 4,773,600,000	6.00
4	日本リテールファンド	日本	投資証券	15,000	229,700.00 3,445,500,000	236,600.00 3,549,000,000	4.46
5	日本プロロジスリート	日本	投資証券	13,000	237,806.24 3,091,481,211	238,900.00 3,105,700,000	3.91
6	API投資法人	日本	投資証券	5,500	498,110.52 2,739,607,913	551,000.00 3,030,500,000	3.81
7	オリックス不動産投資	日本	投資証券	16,000	172,400.00 2,758,400,000	184,500.00 2,952,000,000	3.71
8	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	16,000	172,300.00 2,756,800,000	177,900.00 2,846,400,000	3.58
9	森ヒルズリート	日本	投資証券	18,000	145,600.00 2,620,800,000	157,900.00 2,842,200,000	3.57
10	大和ハウズリート投資法人	日本	投資証券	9,500	285,300.00 2,710,350,000	295,600.00 2,808,200,000	3.53
11	GLP投資法人	日本	投資証券	20,000	129,600.00 2,592,000,000	134,600.00 2,692,000,000	3.39
12	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	8,000	290,000.00 2,320,000,000	309,000.00 2,472,000,000	3.11
13	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	3,300	612,220.74 2,020,328,450	672,000.00 2,217,600,000	2.79
14	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	27,000	75,712.68 2,044,242,393	78,600.00 2,122,200,000	2.67
15	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	3,230	578,000.00 1,866,940,000	590,000.00 1,905,700,000	2.40
16	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	4,000	446,000.00 1,784,000,000	460,500.00 1,842,000,000	2.32
17	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	222,500.00 1,557,500,000	246,400.00 1,724,800,000	2.17
18	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	8,500	178,700.00 1,518,950,000	196,100.00 1,666,850,000	2.10
19	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	6,000	249,174.50 1,495,047,004	266,400.00 1,598,400,000	2.01
20	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	465,500.00 1,396,500,000	511,000.00 1,533,000,000	1.93

21	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	3,000	477,000.00 1,431,000,000	499,500.00 1,498,500,000	1.88
22	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	9,000	143,500.00 1,291,500,000	150,100.00 1,350,900,000	1.70
23	ケネディクスレジデンシャル	日本	投資証券	4,000	297,000.00 1,188,000,000	316,500.00 1,266,000,000	1.59
24	プレミア投資法人	日本	投資証券	9,000	133,300.00 1,199,700,000	138,200.00 1,243,800,000	1.56
25	イオンリート投資	日本	投資証券	9,000	125,293.52 1,127,641,680	127,900.00 1,151,100,000	1.45
26	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	14,000	76,900.00 1,076,600,000	78,400.00 1,097,600,000	1.38
27	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	4,000	242,000.00 968,000,000	262,500.00 1,050,000,000	1.32
28	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	6,500	142,667.26 927,337,241	148,300.00 963,950,000	1.21
29	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	17,000	54,000.00 918,000,000	52,700.00 895,900,000	1.13
30	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	8,000	107,600.00 860,800,000	110,700.00 885,600,000	1.11

(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	97.60%
合計	97.60%

(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28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	54,805,486,677	99.13
内 日本	54,805,486,677	99.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	478,618,108	0.87
純資産総額	55,284,104,785	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28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	35,342,417,410	1.4275 50,452,989,837	1.5507 54,805,486,677	99.13

(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	99.13%
合計	99.13%

(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
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
平成27年12月末日	57,007,183,694	-	1.5563	-
平成28年1月末日	53,882,374,394	-	1.4628	-
2月末日	51,190,551,613	-	1.3871	-
3月末日	55,554,992,755	-	1.4992	-
4月末日	53,852,585,213	-	1.4615	-
5月末日	55,038,901,465	-	1.4867	-
第9計算期間末 (平成28年6月15日)	52,498,863,775	52,498,863,775	1.4155	1.4155
6月末日	52,516,232,771	-	1.4129	-
7月末日	55,504,097,199	-	1.4986	-
8月末日	54,485,581,832	-	1.4642	-
9月末日	53,033,340,357	-	1.4164	-
10月末日	50,298,979,391	-	1.3585	-
11月末日	53,250,292,530	-	1.4514	-
12月末日	55,284,104,785	-	1.5288	-

【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
第9計算期間	0.0000
平成28年6月16日～ 平成28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
第9計算期間	4.6
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	8.0

(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
第9計算期間	11,796,733,279	6,207,605,510
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	4,125,715,902	4,810,774,944

(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28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	53,417,502,619	96.97
内 香港	448,828,013	0.81
内 シンガポール	1,113,067,761	2.02
内 イギリス	3,001,437,724	5.45
内 オランダ	132,466,909	0.24
内 フランス	2,482,742,458	4.51
内 ドイツ	946,558,581	1.72
内 スペイン	374,677,818	0.68
内 カナダ	416,624,015	0.76
内 アメリカ	39,261,454,465	71.27
内 オーストラリア	5,239,644,875	9.51
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,671,160,426	3.03
純資産総額	55,088,663,045	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)	124,502,628	0.23
内 日本	124,502,628	0.23
為替予約取引(売建)	765,482,472	1.39
内 日本	765,482,472	1.39

(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28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	203,151	24,075.22 4,890,917,294	20,499.91 4,164,577,257	7.56
2	UDR INC	アメリカ	投資証券	555,259	4,043.01 2,244,952,648	4,172.67 2,316,913,571	4.21
3	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	358,297	5,999.23 2,149,507,903	6,088.93 2,181,646,176	3.96
4	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	152,866	12,804.46 1,957,379,887	12,243.09 1,871,553,572	3.40
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	156,536	10,735.71 1,680,539,473	11,463.78 1,794,494,407	3.26
6	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	225,344	7,470.27 1,683,382,497	7,418.08 1,671,620,541	3.03
7	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	59,165	25,746.61 1,523,298,760	26,736.78 1,581,881,873	2.87
8	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	178,236	8,897.04 1,585,777,584	8,805.47 1,569,453,373	2.85
9	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	207,994	7,203.27 1,498,241,540	7,190.92 1,495,669,816	2.72
10	KLEPIERRE	フランス	投資証券	304,309	4,952.78 1,507,177,203	4,538.05 1,380,972,348	2.51
11	VICINITY CENTRES	オーストラリア	投資証券	5,447,136	258.14 1,406,132,402	252.23 1,373,965,975	2.49
12	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	453,293	3,188.33 1,445,248,260	2,819.05 1,277,859,258	2.32
13	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,789,566	624.05 1,116,782,244	649.22 1,161,822,039	2.11
14	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	515,856	2,068.27 1,066,967,999	2,184.18 1,126,726,227	2.05
15	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	92,859	11,511.42 1,068,943,447	11,980.99 1,112,543,354	2.02
16	EDUCATION REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	225,673	4,953.73 1,117,931,308	4,879.76 1,101,231,455	2.00
17	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	アメリカ	投資証券	84,765	12,283.98 1,041,253,917	12,866.32 1,090,613,657	1.98
18	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	121,227	9,000.01 1,091,045,109	8,836.93 1,071,274,683	1.94
19	DEXUS PROPERTY GROUP	オーストラリア	投資証券	1,327,760	738.99 981,206,142	805.63 1,069,693,911	1.94
20	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	アメリカ	投資証券	195,430	5,088.28 994,403,186	5,207.10 1,017,624,139	1.85
21	PHYSICIANS REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	438,601	2,307.20 1,011,966,206	2,190.01 960,541,453	1.74

22	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	アメリカ	投資証券	769,617	1,467.89 1,129,716,231	1,241.78 955,697,615	1.73
23	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	ドイツ	投資証券	654,596	1,494.48 978,359,595	1,446.01 946,558,581	1.72
24	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	2,365,413	383.75 907,955,470	388.05 917,912,707	1.67
25	KILROY REALTY CORP	アメリカ	投資証券	107,646	8,051.78 866,742,857	8,326.70 896,336,508	1.63
26	CROWN CASTLE INTL CORP	アメリカ	投資証券	83,337	10,524.40 877,076,968	10,135.79 844,686,740	1.53
27	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	アメリカ	投資証券	201,331	3,724.18 749,793,951	4,001.43 805,612,205	1.46
28	DOUGLAS EMMETT INC	アメリカ	投資証券	183,959	4,175.46 768,125,602	4,190.14 770,814,939	1.40
29	BIG YELLOW GROUP PLC	イギリス	投資証券	779,950	1,076.07 839,284,696	963.10 751,173,745	1.36
30	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	17,407	41,387.73 720,436,253	41,597.41 724,086,187	1.31

(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	96.97%
合計	96.97%

(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

(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 2017年1月	買建	1,069,351	125,332,248	124,502,628	0.23%
		米ドル売/円買 2017年1月	売建	5,500,000	643,621,000	640,310,000	1.16%
		シンガポール・ドル売/円買 2017年1月	売建	911,731	73,628,535	73,473,708	0.13%
		ユーロ売/円買 2017年1月	売建	411,144	50,447,366	50,443,254	0.09%
		香港ドル売/円買 2017年1月	売建	83,645	1,256,347	1,255,510	0.00%

(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) 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28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	47,015,548,737	97.49
内 ケイマン諸島	47,015,548,737	97.49
親投資信託受益証券	323,240,149	0.67
内 日本	323,240,149	0.67
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	887,570,133	1.84
純資産総額	48,226,359,019	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28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	6,694,337.14	6,929.52 46,388,671,050	7,023.18 47,015,548,737	97.49
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	1.0197 323,335,276	1.0194 323,240,149	0.67

(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	97.49%
親投資信託受益証券	0.67%
合計	98.16%

(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
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
平成27年12月末日	38,242,688,125	-	0.4359	-
平成28年1月末日	36,810,051,815	-	0.4117	-
2月末日	34,942,711,950	-	0.3843	-
3月末日	38,002,588,708	-	0.4021	-
4月末日	41,679,770,482	-	0.4166	-
5月末日	43,237,756,866	-	0.4304	-
第9計算期間末 (平成28年6月15日)	42,613,625,618	42,613,625,618	0.4238	0.4238
6月末日	40,590,717,410	-	0.4053	-
7月末日	40,848,085,127	-	0.3899	-
8月末日	42,317,770,529	-	0.3988	-
9月末日	41,681,943,749	-	0.3889	-
10月末日	43,637,094,491	-	0.4117	-
11月末日	45,855,097,858	-	0.4389	-
12月末日	48,226,359,019	-	0.4681	-

【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
第9計算期間	0.0000

平成28年6月16日～ 平成28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
第9計算期間	28.1
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	12.2

(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	2,412,917,551	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
第9計算期間	51,933,802,992	20,145,730,747
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	16,156,611,822	13,474,070,532

(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28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(%)
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	74,631,557,458	100.00
純資産総額	74,631,557,458	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28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

該当事項はありません。

□．投資有価証券の種類別投資比率

該当事項はありません。

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。

(参考) 投資信託証券

Daiwa " RICI " Fund

(1) 有価証券(平成28年12月30日現在)

(単位: USドル)

銘柄名	券面総額	評価額	備考
TREASURY BILL US GOVT OPCT 27APR17	46,000,000	45,937,806.16	
TREASURY BILL US GOVT OPCT 22JUN17	40,000,000	39,899,812.31	
US T-BILL OPCT 05JAN17	38,000,000	37,997,391.74	
TREASURY BILL US GOV OPCT 20JUL17	38,000,000	37,881,075.58	
US TBILL OPCT 2FEB17	36,000,000	35,984,415.12	
TREASURY BILL US GOVT OPCT 25MAY17	36,000,000	35,934,879.00	
TREASURY BILL US GOVT OPCT 14SEP17	35,000,000	34,831,290.30	
US T-BILL 30MAR17	34,000,000	33,967,771.40	
US T-BILL OPCT 16FEB17	25,000,000	24,986,884.99	
TREASURY BILL US GOVT OPCT 02MAR17	24,000,000	23,976,900.72	
TREASURY BILL US GOVT OPCT 17AUG17	24,000,000	23,918,303.21	
TREASURY BILL US GOVT OPCT 15JUN17	10,000,000	9,971,719.98	

(2) 商品先物(平成28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-17	買建	448	-93,468.39	
RAPESEED EURO FUT (EOP) FEB-17	買建	187	290,747.23	
BRENT CRUDE OIL (ICE) MAR-17	買建	1040	5,435,510.00	
COFFEE ROBUSTA (ICE) MAR-17	買建	389	236,720.00	
COPPER GRADE A (LME) JAN-17	買建	139	2,311,243.75	
COPPER GRADE A (LME) JAN-17	売建	139	803,300.00	
COPPER GRADE A (LME) FEB-17	買建	110	-637,956.25	
COPPER GRADE A (LME) FEB-17	売建	1	0.00	
GAS OIL (ICE) FEB-17	買建	107	511,025.00	
NO 7 COCOA (ICE) MAR-17	買建	163	-740,740.74	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-17	買建	391	-241,593.75	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-17	売建	391	154,412.50	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) FEB-17	買建	371	-197,437.50	
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) FEB-17	売建	5	775.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-17	買建	67	-150,855.00	
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-17	売建	67	440,697.00	

銘柄名	買建/売建	数量	評価損益	備考
PRIMARY NICKEL (LME) FEB-17	買建	58	-380,808.00	
PRIMARY NICKEL (LME) FEB-17	売建	1	0.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-17	買建	140	456,700.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-17	売建	140	462,737.50	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) FEB-17	買建	112	-371,550.00	
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) FEB-17	売建	2	5,918.75	
STANDARD LEAD (LME) JAN-17	買建	162	-196,200.00	
STANDARD LEAD (LME) JAN-17	売建	162	1,299,775.00	
STANDARD LEAD (LME) FEB-17	買建	129	-1,037,862.50	
STANDARD LEAD (LME) FEB-17	売建	2	8,100.00	
TIN (LME) JAN-17	買建	41	41,250.00	
TIN (LME) JAN-17	売建	41	2,250.00	
TIN (LME) FEB-17	買建	38	2,700.00	
WHITE SUGAR (ICE) MAR-17	買建	151	-439,880.00	
RUBBER (TCM) MAY-17	買建	373	424,514.42	
CORN (CBT) MAR-17	買建	1060	-686,350.00	
COTTON NO 2 (NYB) MAR-17	買建	466	13,630.00	
FROZEN CONCENTRATED ORANGE JUICE (NYB) MAR-17	買建	76	-315,862.50	
GASOLINE RBOB FUT (NYM) FEB-17	買建	201	1,678,084.80	
GOLD (CMX) FEB-17	買建	167	-2,300,210.00	
HEATING OIL (NYM) FEB-17	買建	111	634,632.60	
HENRY HUB NATURAL GAS (NYM) FEB-17	買建	597	2,959,110.00	
LEAN HOGS (CME) FEB-17	買建	179	810,770.00	
LIGHT SWEET CRUDE OIL (NYM) FEB-17	買建	1333	6,103,220.00	
LIVE CATTLE (CME) FEB-17	買建	180	877,980.00	
LUMBER (CME) MAR-17	買建	105	-234,542.00	
MILK FUTURE (CME) JAN-17	買建	12	560.00	
OAT (CBT) MAR-17	買建	184	84,162.50	
PALLADIUM (NYM) MAR-17	買建	16	65,300.00	
PLATINUM (NYM) APR-17	買建	155	-118,555.00	
ROUGH RICE (CBT) MAR-17	買建	152	-124,770.00	
SILVER (CMX) MAR-17	買建	192	-1,946,255.00	
SOYBEAN MEAL (CBT) MAR-17	買建	91	-7,650.00	
SOYBEAN OIL (CBT) MAR-17	買建	358	-493,632.00	
SOYBEANS (CBT) MAR-17	買建	263	-358,575.00	
SUGAR NO 11 WORLD (NYB) MAR-17	買建	179	-305,603.20	
WHEAT (CBT) MAR-17	買建	912	-1,333,075.00	
WHEAT (CBT) MAR-17	買建	186	-201,050.00	

【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28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	88,152,391,868	73.11
内 日本	88,152,391,868	73.11
投資証券	31,173,179,403	25.85
内 アイルランド	9,428,033,172	7.82
内 ルクセンブルグ	21,745,146,231	18.03

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,253,834,690	1.04
純資産総額	120,579,405,961	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28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・トピックス・ニュートラル	日本	投資信託 受益証券	20,378,613,740	1.0432 21,259,947,817	1.0547 21,493,323,911	17.83
2	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	15,844,404,864	1.1233 17,798,583,551	1.1293 17,893,086,412	14.84
3	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	17,726,518,737	1.0126 17,950,986,040	1.0091 17,887,830,057	14.83
4	T & D米国金利戦略ファンド	日本	投資信託 受益証券	15,526,729,589	1.0482 16,276,582,055	0.9899 15,369,909,620	12.75
5	BLACKROCK STRATEGIC FUNDS - BLACKROCK UK EQUITY ABSOLUTE RETURN FUND CLASS I2 JPY(HEDGED)	ルクセンブ ルグ	投資証券	1,166,765.3	10,104.90 11,790,052,729	10,273.40 11,986,646,633	9.94
6	JPM GLOBAL MACRO OPPORTUNITIES I (ACC) - JPY (HEDGED) FUND	ルクセンブ ルグ	投資証券	1,026,022.46	9,718.78 9,971,691,508	9,511.00 9,758,499,598	8.09
7	S M A M・国内株式ロングショートVファ ンド	日本	投資信託 受益証券	9,613,470,146	1.0089 9,699,676,581	0.9911 9,527,910,261	7.90
8	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	5,061,214,969	1.0669 5,400,089,013	1.1816 5,980,331,607	4.96
9	NB US LONG SHORT EQUITY FUND JPY CLASS	アイルラン ド	投資証券	6,019,925.6	983.92 5,923,145,138	988.73 5,952,081,038	4.94
10	EATON VANCE INTERNATIONAL (IRELAND) GLOBAL MACRO FUND I2YEN CLASS	アイルラン ド	投資証券	3,502,606.97	999.25 3,500,000,000	992.39 3,475,952,134	2.88

(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	73.11%
投資証券	25.85%
合計	98.96%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第1計算期間末 (平成20年6月16日)	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
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
平成27年12月末日	115,111,628,119	-	1.0105	-
平成28年1月末日	115,708,179,500	-	1.0075	-
2月末日	114,483,776,980	-	0.9981	-
3月末日	114,983,915,895	-	0.9995	-
4月末日	116,421,173,812	-	0.9978	-
5月末日	117,509,274,402	-	0.9965	-
第9計算期間末 (平成28年6月15日)	118,204,886,822	118,204,886,822	0.9966	0.9966
6月末日	118,336,475,489	-	0.9979	-
7月末日	120,530,196,675	-	0.9978	-
8月末日	121,198,467,467	-	0.9923	-
9月末日	121,860,689,572	-	0.9891	-
10月末日	121,207,778,507	-	0.9891	-
11月末日	120,154,347,242	-	0.9866	-
12月末日	120,579,405,961	-	0.9899	-

【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
第9計算期間	0.0000
平成28年6月16日～ 平成28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
第9計算期間	2.4
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	0.8

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	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
第9計算期間	41,354,411,267	17,088,865,208
平成28年6月16日～ 平成28年12月15日	17,034,130,819	14,253,518,501

(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

2016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	13,213円
純資産総額	2,660億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.7%
3カ月間	11.6%
6カ月間	19.1%
1年間	0.5%
3年間	22.6%
5年間	157.4%
設定来	32.1%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(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)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円									設定来分配金合計額: 0円		
	第1期 08年6月	第2期 09年6月	第3期 10年6月	第4期 11年6月	第5期 12年6月	第6期 13年6月	第7期 14年6月	第8期 15年6月	第9期 16年6月			
分配金	0円	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・スマート日本株ファンダメンタル・ファンド	20.7%
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	16.8%
大和証券投資信託委託	ダイワ・バリュー株・オープン	14.9%
アセットマネジメントOne	DIAM国内株式アクティブ市場型ファンド	13.9%
JPモルガン・アセット・マネジメント	GIM日本株・ファンド	4.9%
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	4.0%
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%
大和住銀投信投資顧問	大和住銀ニッポン中小型株ファンド	3.0%
BNYメロン・アセット・マネジメント・ジャパン	日本小型株フォーカス・ファンド	3.0%
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	3.0%
合計		87.2%

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、2016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

2016年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	11,581円
純資産総額	1,721億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	5.8%
3カ月間	13.5%
6カ月間	19.8%
1年間	-2.9%
3年間	15.9%
5年間	128.3%
設定来	15.8%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(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)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円									設定来分配金合計額: 0円		
	第1期 08年6月	第2期 09年6月	第3期 10年6月	第4期 11年6月	第5期 12年6月	第6期 13年6月	第7期 14年6月	第8期 15年6月	第9期 16年6月			
分配金	0円	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。

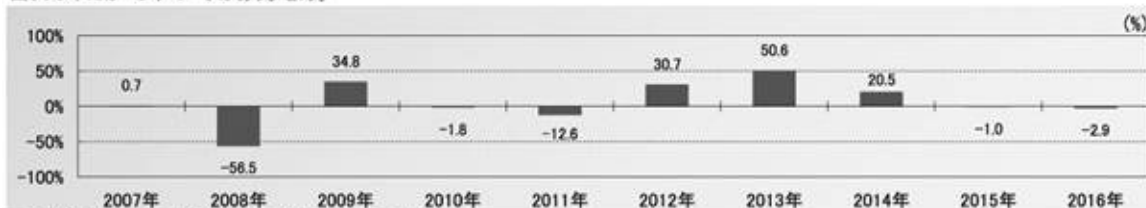
主要な資産の状況

※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
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	26.5%
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	22.5%
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%
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	10.0%
ラザード・アセット・マネジメントLLC	ラザード・ユー・エス・エクイティ・コンセントレイテッド・ファンド	7.8%
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	5.8%
ニッセイアセットマネジメント	ニッセイ米国配当成長株ファンド	4.9%
大和住銀投信投資顧問	T.R.P欧州株式オープン	3.0%
パリュールパートナーズ香港リミテッド	パリュールパートナーズ高配当株式ファンド	1.9%
大和証券投資信託委託	ダイワ・アジア・オセアニア先進国株式ファンド	1.0%
合計		98.2%

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、2016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

2016年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	10,833円
純資産総額	1,196億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	5.4%
3カ月間	12.7%
6カ月間	20.5%
1年間	-0.4%
3年間	12.9%
5年間	111.1%
設定来	8.3%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(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)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円									設定来分配金合計額: 0円		
	第1期 08年6月	第2期 09年6月	第3期 10年6月	第4期 11年6月	第5期 12年6月	第6期 13年6月	第7期 14年6月	第8期 15年6月	第9期 16年6月			
分配金	0円	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。

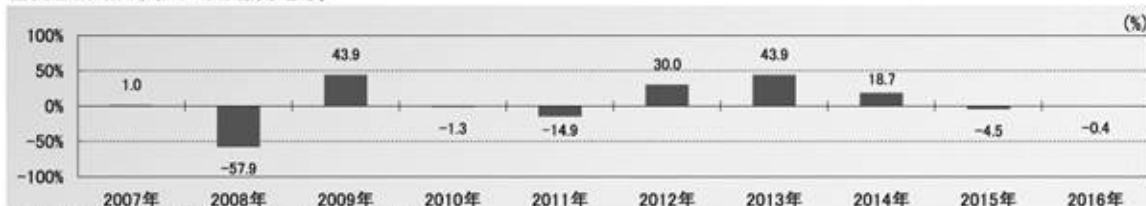
主要な資産の状況

※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
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	21.4%
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	18.1%
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	12.2%
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%
ニッセイアセットマネジメント	ニッセイ/アリオン・欧州グロース株式ファンド	8.0%
ラザード・アセット・マネジメントLLC	ラザード・ユー・エス・エクイティ・コンセントレイテッド・ファンド	6.4%
大和証券投資信託委託	ダイワ新興国株式ファンド	4.8%
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	4.7%
ニッセイアセットマネジメント	ニッセイ米国配当成長株ファンド	3.9%
FILファンド・マネジメント・リミテッド(バミュダ)	フィリティア・ファンズ・インスティテュショナル・エマージング・マーケット・エクイティ・ファンド	2.9%
合計		94.4%

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、2016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

2016年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	11,514円
純資産総額	4,040億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.6%
3カ月間	-1.6%
6カ月間	-3.4%
1年間	2.5%
3年間	6.2%
5年間	9.4%
設定来	15.1%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。
※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(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)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円									設定来分配金合計額: 0円		
	第1期 08年6月	第2期 09年6月	第3期 10年6月	第4期 11年6月	第5期 12年6月	第6期 13年6月	第7期 14年6月	第8期 15年6月	第9期 16年6月			
分配金	0円	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。

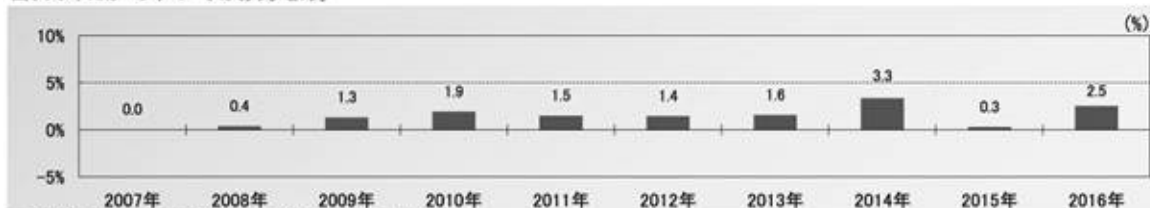
主要な資産の状況

※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・ダイナミック日本債券ファンド	25.8%
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	23.8%
大和証券投資信託委託	ダイワ日本国債ファンド ーラダー20ー	19.9%
NNインベストメント・パートナーズ	NN国内債券ファンド	12.9%
マニユライフ・アセット・マネジメント	マニユライフ日本債券アクティブ・ファンドM	9.9%
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	4.0%
アセットマネジメントOne	国内債券スイッチング戦略ファンド	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、2016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

2016年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	11,413円
純資産総額	1,056億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.1%
3カ月間	5.7%
6カ月間	6.4%
1年間	-4.6%
3年間	3.7%
5年間	45.8%
設定来	15.2%



※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運用管理費用(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)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円					設定来分配金合計額: 100円					
	第1期 08年6月	第2期 09年6月	第3期 10年6月	第4期 11年6月	第5期 12年6月	第6期 13年6月	第7期 14年6月	第8期 15年6月	第9期 16年6月		
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	100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。

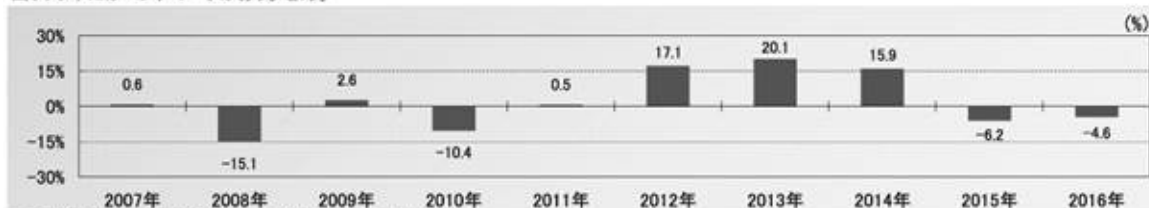
主要な資産の状況

※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
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	24.7%
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	14.9%
ブルーベイ・アセット・マネジメント・エルエルピー	ブルーベイ欧州総合債券ファンド	14.0%
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・グローバル総合債券(除く日本)ファンド クラスS(円ヘッジ無、分配金有)	13.9%
大和証券投資信託委託	ダイワ米国債券ファンド	11.8%
大和証券投資信託委託	ダイワ欧州債券ファンド	8.9%
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	5.8%
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	グローバル・ハイ・イールド・ポートフォリオII	3.2%
大和証券投資信託委託	ダイワ/デカ欧州債券アクティブ・ファンド	2.0%
合計		99.2%

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、2016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

2016年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	12,331円
純資産総額	476億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.6%
3カ月間	6.5%
6カ月間	7.8%
1年間	-2.5%
3年間	8.2%
5年間	53.6%
設定来	24.4%



※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運用管理費用(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)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円					設定来分配金合計額: 100円					
	第1期 08年6月	第2期 09年6月	第3期 10年6月	第4期 11年6月	第5期 12年6月	第6期 13年6月	第7期 14年6月	第8期 15年6月	第9期 16年6月		
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	100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。

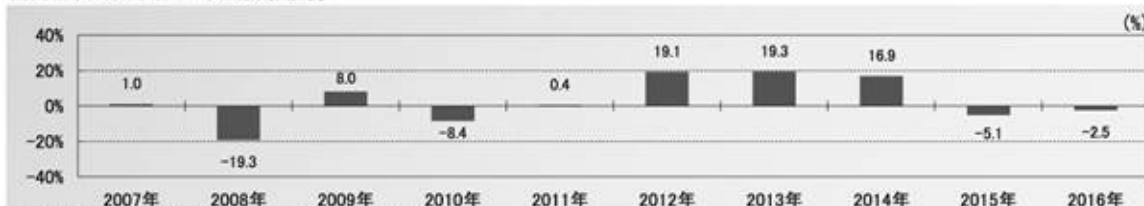
主要な資産の状況

※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
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	19.6%
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	エマージング・マーケット債券ファンド	12.1%
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	12.0%
ブルーベイ・アセット・マネジメント・エルエルピー	ブルーベイ欧州総合債券ファンド	11.2%
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・グローバル総合債券(除く日本)ファンド クラスS(円ヘッジ無、分配金有)	11.1%
大和証券投資信託委託	ダイワ米国債券ファンド	9.4%
大和証券投資信託委託	ダイワ欧州債券ファンド	7.0%
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	4.9%
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	4.7%
大和住銀投信投資顧問	T. ロウ・プライス新興国債券オープンM	2.9%
合計		94.9%

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、2016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

2016年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	16,648円
純資産総額	713億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	3.7%
3カ月間	2.5%
6カ月間	2.4%
1年間	9.6%
3年間	38.9%
5年間	180.9%
設定来	67.8%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円									設定来分配金合計額: 100円		
	第1期 08年6月	第2期 09年6月	第3期 10年6月	第4期 11年6月	第5期 12年6月	第6期 13年6月	第7期 14年6月	第8期 15年6月	第9期 16年6月			
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	100円	0円	0円			

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

主要な資産の状況

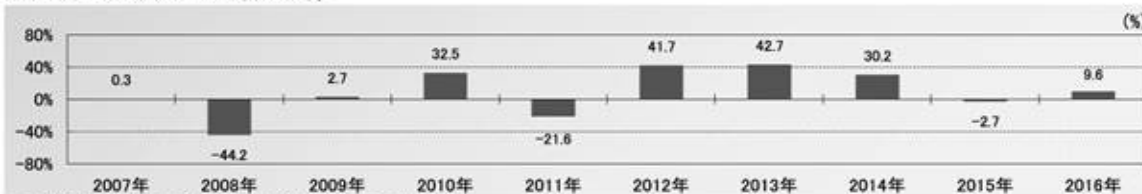
※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	比率
国内リート	47	97.6%	オフィス不動産	33.0%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産	7.4%
			各種不動産	28.4%	日本ビルファンド	オフィス不動産	6.9%
			工業用不動産	11.9%	野村不動産マスターF	各種不動産	6.0%
			住宅用不動産	10.5%	日本リテールファンド	店舗用不動産	4.5%
			店舗用不動産	10.0%	日本プロロジスリート	工業用不動産	3.9%
			ホテル・リゾート不動産	3.6%	API投資法人	各種不動産	3.8%
			ヘルスケア不動産	0.1%	オリックス不動産投資	オフィス不動産	3.7%
					ユナイテッド・アーバン投資法人	各種不動産	3.6%
					森ヒルズリート	オフィス不動産	3.6%
コール・ローン、その他		2.4%			大和ハウスリート投資法人	各種不動産	3.5%
合計	47	100.0%	合計	97.6%	合計		46.9%

※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(GIGS)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、2016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

2016年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	15,288円
純資産総額	552億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	5.3%
3カ月間	7.9%
6カ月間	8.2%
1年間	-1.8%
3年間	49.4%
5年間	149.0%
設定来	54.2%



※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運用管理費用(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)

決算期	直近1年間分配金合計額: 0円									設定来分配金合計額: 100円	
	第1期 08年6月	第2期 09年6月	第3期 10年6月	第4期 11年6月	第5期 12年6月	第6期 13年6月	第7期 14年6月	第8期 15年6月	第9期 16年6月		
分配金	0円	0円	0円	0円	0円	0円	100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。

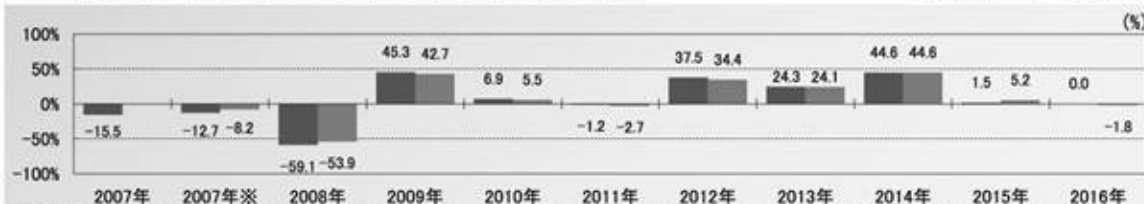
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	リート用途別構成	比率	組入上位10銘柄	用途名	国・地域名	比率
外国リート	63	96.1%	米ドル	72.5%	商業施設	21.0%	SIMON PROPERTY GROUP INC	商業施設	アメリカ	7.5%
			豪ドル	9.8%	住宅	18.7%	UDR INC	住宅	アメリカ	4.2%
			ユーロ	7.1%	オフィス	18.4%	PROLOGIS INC	産業施設	アメリカ	3.9%
合計	63	100.0%	英ポンド	5.6%	各種不動産	7.9%	SL GREEN REALTY CORP	オフィス	アメリカ	3.4%
			香港ドル	1.6%	産業施設	6.0%	DIGITAL REALTY TRUST INC	特殊用途施設	アメリカ	3.2%
国・地域別構成			シンガポール・ドル	1.4%	ヘルスケア	6.0%	EQUITY RESIDENTIAL	住宅	アメリカ	3.0%
アメリカ		70.7%	日本円	1.3%	特殊用途施設	5.7%	ESSEX PROPERTY TRUST INC	住宅	アメリカ	2.8%
オーストラリア		9.4%	カナダ・ドル	0.8%	貸倉庫	5.3%	EXTRA SPACE STORAGE INC	貸倉庫	アメリカ	2.8%
イギリス		5.4%			ホテル/リゾート	4.4%	VENTAS INC	ヘルスケア	アメリカ	2.7%
フランス		4.5%			その他	2.8%	KLEPIERRE	商業施設	フランス	2.5%
その他		6.2%								
合計		96.1%	合計	100.0%	合計	96.1%	合計			36.0%

※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※は設定日(11月1日)から年末、2016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

2016年12月30日現在
基準価額・純資産の推移

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

基準価額	4,681円
純資産総額	482億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	6.7%
3カ月間	20.4%
6カ月間	15.5%
1年間	7.4%
3年間	-30.6%
5年間	-10.3%
設定来	-51.1%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(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	第9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	16年6月		
分配金	500円	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。

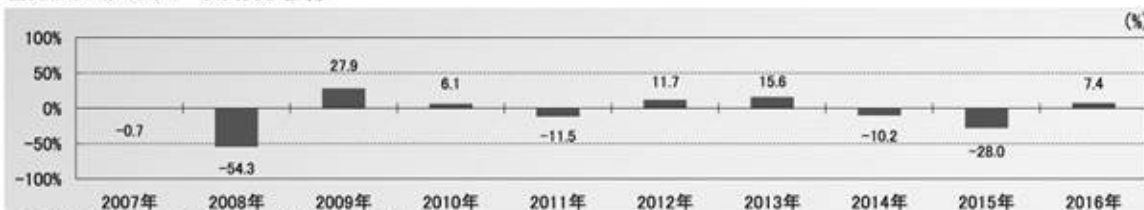
主要な資産の状況

※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
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	97.5%
大和証券投資信託委託	ダイワ・マネー・マザーファンド	0.7%
合計		98.2%

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、2016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

2016年12月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	9,899円
純資産総額	1,205億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.3%
3カ月間	0.1%
6カ月間	-0.8%
1年間	-2.0%
3年間	-0.1%
5年間	-0.3%
設定来	-1.0%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※「分配金再投資基準価額」は、分配金(税引前)を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算しています。※基準価額の計算において実質的な運用管理費用(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	第9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	16年6月			
分配金	0円	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

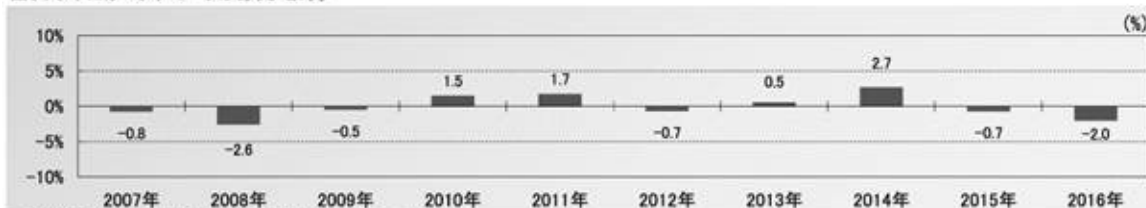
※比率は、純資産総額に対するものです。

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・トピックス・ニュートラル	17.8%
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	14.8%
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	14.8%
T&Dアセットマネジメント	T&D米国金利戦略ファンド	12.7%
ブラックロック・インベストメント・マネジメント(UK)リミテッド	ブラックロックUKエクイティ・アブソリュート・リターン・ファンド	9.9%
JPMorgan・アセット・マネジメント(UK)リミテッド	JPMグローバル・マクロ・オポチュニティーズ	8.1%
三井住友アセットマネジメント	SMAM・国内株式ロングショートVファンド	7.9%
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	5.0%
ニューバーガー・パーマン・ヨーロッパ・リミテッド	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	4.9%
イトン・ウァンス・アドバイザーズ(アイルランド)リミテッド	イトン・ウァンス・インターナショナル(アイルランド)グローバル・マクロ・ファンド	2.9%
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、2016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28年6月16日から平成28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28年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		2,997,253,349
投資信託受益証券		268,171,139,576
未収入金		218,000,000
流動資産合計		271,386,392,925
資産合計		271,386,392,925
負債の部		
流動負債		
未払解約金		748,691,919
未払受託者報酬		52,928,364
未払委託者報酬		529,284,071
その他未払費用		1,083,052
流動負債合計		1,331,987,406
負債合計		1,331,987,406
純資産の部		
元本等		
元本	1	202,689,746,579
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		67,364,658,940
（分配準備積立金）		32,186,446,161
元本等合計		270,054,405,519
純資産合計		270,054,405,519
負債純資産合計		271,386,392,925

[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28年6月16日 至 平成28年12月15日
	金額(円)
営業収益	
受取配当金	536,532,617
有価証券売買等損益	42,970,680,663
営業収益合計	43,507,213,280
営業費用	
支払利息	636,278
受託者報酬	52,928,364
委託者報酬	529,284,071
その他費用	1,083,337
営業費用合計	583,932,050
営業利益又は営業損失()	42,923,281,230
経常利益又は経常損失()	42,923,281,230
中間純利益又は中間純損失()	42,923,281,230
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()	2,160,912,786
期首剰余金又は期首欠損金()	25,289,015,674
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,838,823,672
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	4,838,823,672
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,525,548,850
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,525,548,850
中間剰余金又は中間欠損金()	67,364,658,940

[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28年6月16日 至 平成28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28年12月15日現在
1. 1期首元本額	201,392,809,214円
期中追加設定元本額	29,073,480,607円
期中一部解約元本額	27,776,543,242円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	202,689,746,579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28年6月16日 至 平成28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28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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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28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28年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.3324円
（1万口当たり純資産額）	(13,324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28年6月16日から平成28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28年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		3,271,702,864
投資信託受益証券		155,252,864,670
投資証券		13,246,235,143
流動資産合計		171,770,802,677
資産合計		171,770,802,677
負債の部		
流動負債		
未払解約金		377,911,816
未払受託者報酬		33,504,862
未払委託者報酬		335,048,982
その他未払費用		1,065,522
流動負債合計		747,531,182
負債合計		747,531,182
純資産の部		
元本等		
元本	1	148,120,760,750
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		22,902,510,745
（分配準備積立金）		17,293,213,700
元本等合計		171,023,271,495
純資産合計		171,023,271,495
負債純資産合計		171,770,802,677

[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28年6月16日 至 平成28年12月15日
	金額(円)
営業収益	
有価証券売買等損益	18,423,853,489
為替差損益	467,080,220
営業収益合計	18,890,933,709
営業費用	
支払利息	521,960
受託者報酬	33,504,862
委託者報酬	335,048,982
その他費用	1,393,264
営業費用合計	370,469,068
営業利益又は営業損失()	18,520,464,641
経常利益又は経常損失()	18,520,464,641
中間純利益又は中間純損失()	18,520,464,641
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()	218,811,099
期首剰余金又は期首欠損金()	4,555,476,513
剰余金増加額又は欠損金減少額	618,204,550
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	618,204,550
剰余金減少額又は欠損金増加額	572,823,860
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	572,823,860
中間剰余金又は中間欠損金()	22,902,510,745

[次へ](#)

(3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成28年6月16日 至 平成28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. 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28年12月15日現在
1. 1期首元本額	143,474,245,487円
期中追加設定元本額	23,853,496,605円
期中一部解約元本額	19,206,981,342円

2. 中間計算期間末日における受益権の総数	148,120,760,750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28年6月16日 至 平成28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28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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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28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28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)	1.1546円 (11,546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28年6月16日から平成28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28年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,332,467,692
投資信託受益証券		93,582,209,943
投資証券		26,084,928,620
未収入金		90,000,000
流動資産合計		121,089,606,255
資産合計		121,089,606,255
負債の部		
流動負債		
未払解約金		263,782,578
未払受託者報酬		24,351,863
未払委託者報酬		243,518,995
その他未払費用		1,068,733
流動負債合計		532,722,169
負債合計		532,722,169
純資産の部		
元本等		
元本	1	111,160,650,486
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		9,396,233,600
（分配準備積立金）		18,963,358,151
元本等合計		120,556,884,086
純資産合計		120,556,884,086
負債純資産合計		121,089,606,255

[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28年6月16日 至 平成28年12月15日 金額(円)
営業収益	
受取配当金	151,075,670
有価証券売買等損益	13,801,654,026
為替差損益	1,395,072,274
営業収益合計	15,347,801,970
営業費用	
支払利息	320,406
受託者報酬	24,351,863
委託者報酬	243,518,995
その他費用	1,396,388
営業費用合計	269,587,652
営業利益又は営業損失()	15,078,214,318
経常利益又は経常損失()	15,078,214,318
中間純利益又は中間純損失()	15,078,214,318
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()	383,046,757
期首剰余金又は期首欠損金()	5,605,858,338
剰余金増加額又は欠損金減少額	687,574,582
中間一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	687,574,582
剰余金減少額又は欠損金増加額	380,650,205
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	380,650,205
中間剰余金又は中間欠損金()	9,396,233,600

[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28年6月16日 至 平成28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28年12月15日現在
1. 1期首元本額	115,987,175,126円

期中追加設定元本額	9,338,979,599円
期中一部解約元本額	14,165,504,239円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	111,160,650,486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28年6月16日 至 平成28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28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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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28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28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)	1.0845円 (10,845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28年6月16日から平成28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28年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		4,600,118,163
投資信託受益証券		401,796,970,159
流動資産合計		406,397,088,322
資産合計		406,397,088,322
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,231,245,877
未払受託者報酬		45,280,291
未払委託者報酬		452,803,480
その他未払費用		1,062,040
流動負債合計		1,730,391,688
負債合計		1,730,391,688
純資産の部		
元本等		
元本	1	352,311,442,884
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		52,355,253,750
（分配準備積立金）		23,432,476,950
元本等合計		404,666,696,634
純資産合計		404,666,696,634
負債純資産合計		406,397,088,322

[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28年6月16日 至 平成28年12月15日
	金額(円)
営業収益	
有価証券売買等損益	11,204,288,160
営業収益合計	11,204,288,160
営業費用	
支払利息	1,011,300
受託者報酬	45,280,291
委託者報酬	452,803,480
その他費用	1,062,722
営業費用合計	500,157,793
営業利益又は営業損失()	11,704,445,953
経常利益又は経常損失()	11,704,445,953
中間純利益又は中間純損失()	11,704,445,953
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()	460,309,759
期首剰余金又は期首欠損金()	66,616,341,749
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,597,102,036
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	7,597,102,036
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,614,053,841
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	10,614,053,841
中間剰余金又は中間欠損金()	52,355,253,750

[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28年6月16日 至 平成28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28年12月15日現在
1. 1期首元本額	366,027,452,299円
期中追加設定元本額	44,710,888,531円
期中一部解約元本額	58,426,897,946円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	352,311,442,884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28年6月16日 至 平成28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28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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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28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28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)	1.1486円 (11,486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28年6月16日から平成28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28年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		22,639,458
コール・ローン		1,541,033,174
投資信託受益証券		100,723,281,213
投資証券		3,459,895,323
流動資産合計		105,746,849,168
資産合計		105,746,849,168
負債の部		
流動負債		
未払解約金		273,491,513
未払受託者報酬		22,002,540
未払委託者報酬		220,025,875
その他未払費用		1,058,056
流動負債合計		516,577,984
負債合計		516,577,984
純資産の部		
元本等		
元本	1	92,886,393,847
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		12,343,877,337
（分配準備積立金）		6,250,218,088
元本等合計		105,230,271,184
純資産合計		105,230,271,184
負債純資産合計		105,746,849,168

[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28年6月16日 至 平成28年12月15日
	金額(円)
営業収益	
受取配当金	497,555,981
有価証券売買等損益	2,135,573,224
為替差損益	267,760,592
営業収益合計	2,900,889,797
営業費用	
支払利息	302,196
受託者報酬	22,002,540
委託者報酬	220,025,875
その他費用	1,259,039
営業費用合計	243,589,650
営業利益又は営業損失()	2,657,300,147
経常利益又は経常損失()	2,657,300,147
中間純利益又は中間純損失()	2,657,300,147
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	173,032,601
期首剰余金又は期首欠損金()	9,517,588,572
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,159,741,968
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,159,741,968
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,163,785,951
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,163,785,951
中間剰余金又は中間欠損金()	12,343,877,337

[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28年6月16日 至 平成28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28年12月15日現在
1. 1期首元本額	90,475,144,467円

期中追加設定元本額	13,701,557,535円
期中一部解約元本額	11,290,308,155円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	92,886,393,847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28年6月16日 至 平成28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28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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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28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28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)	1.1329円 (11,329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28年6月16日から平成28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28年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		8,455,173
コール・ローン		542,746,620
投資信託受益証券		45,645,999,767
投資証券		1,292,169,234
流動資産合計		47,489,370,794
資産合計		47,489,370,794
負債の部		
流動負債		
未払解約金		84,003,390
未払受託者報酬		10,102,289
未払委託者報酬		101,023,231
その他未払費用		1,068,748
流動負債合計		196,197,658
負債合計		196,197,658
純資産の部		
元本等		
元本	1	38,742,046,573
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		8,551,126,563
（分配準備積立金）		5,148,303,170
元本等合計		47,293,173,136
純資産合計		47,293,173,136
負債純資産合計		47,489,370,794

[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28年6月16日 至 平成28年12月15日
	金額(円)
営業収益	
受取配当金	302,843,848
有価証券売買等損益	1,509,544,929
為替差損益	98,048,900
その他収益	241,172
営業収益合計	1,910,678,849
営業費用	
支払利息	127,439
受託者報酬	10,102,289
委託者報酬	101,023,231
その他費用	1,269,636
営業費用合計	112,522,595
営業利益又は営業損失()	1,798,156,254
経常利益又は経常損失()	1,798,156,254
中間純利益又は中間純損失()	1,798,156,254
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	39,908,851
期首剰余金又は期首欠損金()	7,070,609,487
剰余金増加額又は欠損金減少額	550,280,606
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	550,280,606
剰余金減少額又は欠損金増加額	907,828,635
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	907,828,635
中間剰余金又は中間欠損金()	8,551,126,563

[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28年6月16日 至 平成28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28年12月15日現在
1. 1期首元本額	40,560,448,266円

期中追加設定元本額	3,414,923,059円
期中一部解約元本額	5,233,324,752円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	38,742,046,573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28年6月16日 至 平成28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28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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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28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28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)	1.2207円 (12,207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28年6月16日から平成28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28年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		423,275,576
親投資信託受益証券		68,759,961,518
未収入金		40,000,000
流動資産合計		69,223,237,094
資産合計		69,223,237,094
負債の部		
流動負債		
未払解約金		198,235,100
未払受託者報酬		15,070,767
未払委託者報酬		226,062,113
その他未払費用		1,054,718
流動負債合計		440,422,698
負債合計		440,422,698
純資産の部		
元本等		
元本	1	43,058,050,778
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		25,724,763,618
（分配準備積立金）		10,154,925,493
元本等合計		68,782,814,396
純資産合計		68,782,814,396
負債純資産合計		69,223,237,094

[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28年6月16日 至 平成28年12月15日
	金額(円)
営業収益	
有価証券売買等損益	943,273,047
営業収益合計	943,273,047
営業費用	
支払利息	55,433
受託者報酬	15,070,767
委託者報酬	226,062,113
その他費用	1,054,735
営業費用合計	242,243,048
営業損失()	1,185,516,095
経常損失()	1,185,516,095
中間純損失()	1,185,516,095
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	117,346,156
期首剰余金又は期首欠損金()	27,760,780,897
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,249,243,066
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	3,249,243,066
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,217,090,406
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	4,217,090,406
中間剰余金又は中間欠損金()	25,724,763,618

[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28年6月16日 至 平成28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28年12月15日現在
1. 1期首元本額	44,401,148,845円
期中追加設定元本額	5,411,089,659円
期中一部解約元本額	6,754,187,726円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	43,058,050,778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28年6月16日 至 平成28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28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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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28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28年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.5974円

(1万口当たり純資産額)	(15,974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28年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,425,082,527
投資証券		75,414,895,000
未収入金		253,335,065
未収配当金		463,910,060
流動資産合計		77,557,222,652
資産合計		77,557,222,652
負債の部		
流動負債		
未払金		965,193,469
未払解約金		49,700,000
流動負債合計		1,014,893,469
負債合計		1,014,893,469
純資産の部		
元本等		
元本	1	32,357,398,632
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		44,184,930,551
元本等合計		76,542,329,183
純資産合計		76,542,329,183
負債純資産合計		77,557,222,652

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28年6月16日 至 平成28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28年12月15日現在
1. 1 期首 期首元本額	平成28年6月16日 33,200,113,799円

期中追加設定元本額	1,765,712,304円
期中一部解約元本額	2,608,427,471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)	24,485,289円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	22,727,846円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	105,471,338円
6資産バランスファンド(分配型)	196,218,407円
6資産バランスファンド(成長型)	378,010,650円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	62,749,137円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	2,504,007円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	66,767,352円
成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-07	56,976,460円
成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-08	55,471,217円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	166,798,259円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	226,380,204円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	262,346,012円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	466,535,584円
ダイワファンドラップ J-REIT セレクト	29,067,834,081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)	151,086,123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)	44,780,998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)	240,357,193円
ダイワJリート・ファンド	759,898,475円
計	32,357,398,632円
2. 期末日における受益権の総数	32,357,398,632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28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等
これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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28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28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)	2.3655円 (23,655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28年6月16日から平成28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28年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		536,294,757
親投資信託受益証券		55,530,966,338
流動資産合計		56,067,261,095
資産合計		56,067,261,095
負債の部		
流動負債		
未払解約金		152,319,385
未払受託者報酬		11,416,064
未払委託者報酬		242,592,312
その他未払費用		1,068,158
流動負債合計		407,395,919
負債合計		407,395,919
純資産の部		
元本等		
元本	1	36,402,332,835
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		19,257,532,341
（分配準備積立金）		8,464,150,670
元本等合計		55,659,865,176
純資産合計		55,659,865,176
負債純資産合計		56,067,261,095

[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28年6月16日 至 平成28年12月15日
	金額(円)
営業収益	
有価証券売買等損益	4,366,949,943
営業収益合計	4,366,949,943
営業費用	
支払利息	122,177
受託者報酬	11,416,064
委託者報酬	242,592,312
その他費用	1,068,239
営業費用合計	255,198,792
営業利益	4,111,751,151
経常利益	4,111,751,151
中間純利益	4,111,751,151
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	8,883,066
期首剰余金又は期首欠損金()	15,411,471,898
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,745,081,962
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,745,081,962
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,001,889,604
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	2,001,889,604
中間剰余金又は中間欠損金()	19,257,532,341

[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28年6月16日 至 平成28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28年12月15日現在
1. 1 期首元本額	37,087,391,877円
期中追加設定元本額	4,125,715,902円
期中一部解約元本額	4,810,774,944円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	36,402,332,835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28年6月16日 至 平成28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	136,221,674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28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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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28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28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)	1.5290円 (15,290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28年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		1,640,871,319
コール・ローン		83,592,710
投資証券		54,136,790,797
派生商品評価勘定		171
未収入金		248,981,802
未収配当金		59,561,015
流動資産合計		56,169,797,814
資産合計		56,169,797,814
負債の部		
流動負債		
未払金		344,001,629
未払解約金		13,000,000
流動負債合計		357,001,629
負債合計		357,001,629
純資産の部		
元本等		
元本	1	36,003,774,338
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		19,809,021,847
元本等合計		55,812,796,185
純資産合計		55,812,796,185
負債純資産合計		56,169,797,814

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28年6月16日 至 平成28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28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	<p>平成28年6月16日 36,754,746,266円 729,331,970円 1,480,303,898円</p>
<p>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)</p>	<p>35,821,807,727円 141,007,593円 40,959,018円</p>
計	36,003,774,338円
2. 期末日における受益権の総数	36,003,774,338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28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	<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)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。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等</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

通貨関連

種 類	平成28年12月15日 現在			評価損益 (円)
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	65,686	-	65,681	5
ユーロ	65,686	-	65,681	5
買 建	65,686	-	65,852	166
アメリカ・ドル	65,686	-	65,852	166
合計	131,372	-	131,533	171

(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28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)	1.5502円 (15,502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28年6月16日から平成28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28年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		17,063
コール・ローン		686,562,543
投資信託受益証券		48,352,502,230
親投資信託受益証券		323,240,149
流動資産合計		49,362,321,985
資産合計		49,362,321,985
負債の部		
流動負債		
未払解約金		173,224,575
未払受託者報酬		9,153,822
未払委託者報酬		68,654,055
その他未払費用		1,076,713
流動負債合計		252,109,165
負債合計		252,109,165
純資産の部		
元本等		
元本	1	103,239,869,383
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2	54,129,656,563
（分配準備積立金）		705,490,791
元本等合計		49,110,212,820
純資産合計		49,110,212,820
負債純資産合計		49,362,321,985

[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28年6月16日 至 平成28年12月15日 金額(円)
営業収益	
受取利息	17,064
有価証券売買等損益	867,362,863
為替差損益	4,800,782,583
営業収益合計	5,668,162,510
営業費用	
支払利息	139,489
受託者報酬	9,153,822
委託者報酬	68,654,055
その他費用	1,262,934
営業費用合計	79,210,300
営業利益又は営業損失()	5,588,952,210
経常利益又は経常損失()	5,588,952,210
中間純利益又は中間純損失()	5,588,952,210
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	153,866,490
期首剰余金又は期首欠損金()	57,943,702,475
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,803,899,408
中間一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	7,803,899,408
剰余金減少額又は欠損金増加額	9,732,672,196
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	9,732,672,196
中間剰余金又は中間欠損金()	54,129,656,563

[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28年6月16日 至 平成28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28年12月15日現在
1. 1 期首元本額	100,557,328,093円
期中追加設定元本額	16,156,611,822円
期中一部解約元本額	13,474,070,532円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	103,239,869,383口
3. 2 元本の欠損	<p>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54,129,656,563円であります。</p>

（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28年6月16日 至 平成28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28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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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28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28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)	0.4757円 (4,757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28年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		67,316,211,870
国債証券		6,570,159,058
現先取引勘定		999,999,260
その他未収収益		744,666
流動資産合計		74,887,114,854
資産合計		74,887,114,854
負債の部		
流動負債		
流動負債合計		-
負債合計		-
純資産の部		
元本等		
元本	1	73,459,725,161
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,427,389,693
元本等合計		74,887,114,854
純資産合計		74,887,114,854
負債純資産合計		74,887,114,854

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28年6月16日 至 平成28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>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成28年12月15日現在
1. 1 期首	平成28年6月16日
期首元本額	49,076,500,809円
期中追加設定元本額	125,608,168,648円
期中一部解約元本額	101,224,944,296円
期末元本額の内訳 ファンド名	

ダイワF Eグローバル・バ リュウ(為替ヘッジあり)	98,069円
ダイワF Eグローバル・バ リュウ(為替ヘッジなし)	98,069円
ダイワ/“R I C I®”コモ ディティ・ファンド	8,952,508円
U S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
U S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	1,987,559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
堅実バランスファンド - ハジ メの一步 -	130,680,097円
D Cダイワ・マネー・ポート フォリオ	2,514,562,237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 -	29,484,934円
(適格機関投資家専用)ス マート・シックス・Dガード	30,488,921円
ブルベア・マネー・ポート フォリオ	24,438,176,600円
ブル3倍日本株ポートフォリオ	39,808,624,092円
ベア2倍日本株ポートフォリオ	5,531,594,469円
ダイワF Eグローバル・バ リュウ株ファンド(ダイワS MA専用)	4,090,590円

ダイワ米国高金利社債ファンド(通貨選択型)ブラジル・リアル・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	4,974,315円
ダイワ日本リート・ファンド・マネー・ポートフォリオ	199,406,437円
ダイワ新興国ハイインカム・プラス - 金積立型 -	501,660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	1,004,378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)	2,913,729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)	988,283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)	4,926,018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	1,724,477円
ダイワ・世界コモディティ・ファンド(ダイワSMA専用)	274,626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	73,459,725,161円
2. 期末日における受益権の総数	73,459,725,161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28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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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28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28年12月15日現在
1口当たり純資産額	1.0194円
（1万口当たり純資産額）	（10,194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。

財政状態計算書

2016年4月30日現在

	米ドル
資産	
現金	35,835,858
証拠金	31,955,928
受取勘定	1,876
損益通算公正価値金融資産	352,533,239
資産合計	420,326,901
資本	
受益証券元本	509,107,296
剰余金	(119,066,976)
資本合計	390,040,320
負債	
未払証拠金	1,604,202
支払勘定 - 1年以内に支払期限が到来するもの	25,258,732
損益通算公正価値金融負債	3,423,647
負債合計	30,286,581
資本および負債合計	420,326,901

包括利益計算書

2016年4月30日に終了した年度

	米ドル
収入	
利息収入	14,974
損益通算公正価値金融資産および負債による純損失	(71,501,777)

純投資損失合計	(71,486,803)
費用	
運用会社報酬	2,712,283
管理報酬	493,143
受託会社報酬	32,884
資産保管報酬	49,325
仲介手数料	625,564
監査費用	24,459
その他の費用	10,777
費用合計	3,948,435
当会計年度の営業損失	(75,435,238)
金融費用	
支払利息	(17,848)
金融費用合計	(17,848)
包括利益合計	(75,453,086)

組入資産の明細

2016年4月30日現在

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 26-May-2016	34,000,000	33,995,535	8.71
US T-Bill 0% YLD 09-Jun-2016	24,000,000	23,986,740	6.15
US T-Bill 0% YLD 07-Jul-2016	34,000,000	33,974,237	8.71
US T-Bill 0% YLD 18-Aug-2016	36,000,000	35,949,533	9.22
US T-Bill 0% YLD 15-Sep-2016	37,000,000	36,934,829	9.47
US T-Bill 0% YLD 13-Oct-2016	35,000,000	34,936,156	8.96
US T-Bill 0% YLD 10-Nov-2016	29,000,000	28,938,588	7.42
US T-Bill 0% YLD 08-Dec-2016	37,000,000	36,922,159	9.47
US T-Bill 0% YLD 05-Jan-2017	38,000,000	37,907,261	9.71
US T-Bill 0% YLD 02-Feb-2017	20,000,000	19,931,960	5.11

債券合計

323,476,998

82.93

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-2016	395	3,638,009	43,690	-
Rapeseed (EOP) - Aug-2016	181	3,665,222	105,697	-
		7,303,231	149,387	-
日本				
Rubber (TCM) - Oct-2016	445	4,009,433	-	(16,894)
		4,009,433	-	(16,894)
英国				
Brent Crude Oil (ICE) - Jul-2016	770	30,988,020	5,794,880	-
Brent Crude Oil (ICE) - Aug-2016	357	17,175,270	-	-
Coffee Robusta (ICE) - Jul-2016	478	7,320,130	222,710	-
Copper Grade A (LME) - May-2016	111	13,085,625	670,744	-
Copper Grade A (LME) - May-2016	(111)	(13,492,456)	-	(263,913)
Copper Grade A (LME) - Jun-2016	117	14,190,769	287,981	-
Copper Grade A (LME) - Jun-2016	(39)	(4,826,250)	-	-
Copper Grade A (LME) - Jul-2016	42	5,192,513	-	-
Gas Oil (ICE) - Jun-2016	82	2,912,700	502,600	-
Gas Oil (ICE) - Jul-2016	38	1,592,200	-	-
No. 7 Cocoa (LIF) - Jul-2016	115	3,620,265	199,604	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2016	328	12,859,738	783,013	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - May-2016	(328)	(12,375,106)	-	(1,267,644)
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2016	387	14,650,813	1,489,506	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jun-2016	(130)	(5,421,813)	-	-
Primary High Grade Aluminium (LME) - Jul-2016	126	5,253,413	-	-
Primary Nickel (LME) - May-2016	64	3,286,932	271,980	-
Primary Nickel (LME) - May-2016	(64)	(3,222,855)	-	(336,057)
Primary Nickel (LME) - Jun-2016	71	3,591,644	361,211	-
Primary Nickel (LME) - Jun-2016	(24)	(1,336,176)	-	-
Primary Nickel (LME) - Jul-2016	24	1,338,192	-	-

Special High Grade Zinc (LME) - May-2016	148	6,542,925	512,050	-
Special High Grade Zinc (LME) - May-2016	(148)	(6,747,506)	-	(307,469)
Special High Grade Zinc (LME) - Jun-2016	162	7,399,488	332,975	-
Special High Grade Zinc (LME) - Jun-2016	(55)	(2,625,219)	-	-
Special High Grade Zinc (LME) - Jul-2016	55	2,629,688	-	-
Standard Lead (LME) - May-2016	152	6,693,756	-	(49,456)
Standard Lead (LME) - May-2016	(152)	(6,555,263)	-	(89,038)
Standard Lead (LME) - Jun-2016	165	7,126,531	94,281	-
Standard Lead (LME) - Jun-2016	(55)	(2,406,938)	-	-
Standard Lead (LME) - Jul-2016	60	2,626,875	-	-
Tin (LME) - May-2016	40	3,188,555	240,845	-
Tin (LME) - May-2016	(40)	(3,357,550)	-	(71,850)
Tin (LME) - Jun-2016	43	3,607,225	77,230	-
Tin (LME) - Jun-2016	(15)	(1,285,275)	-	-
Tin (LME) - Jul-2016	15	1,283,025	-	-
White Sugar (ICE) - Aug-2016	163	3,587,720	142,535	-
		118,091,605	11,984,145	(2,385,427)

米国

Corn (CBT) - Jul-2016	921	16,691,188	1,325,875	-
Cotton No. 2 (NYB) - Jul-2016	520	15,191,100	1,368,300	-
Frozen Concentrated Orange Juice (NYB) - Jul-2016	111	2,392,800	-	(297,398)
Gasoline RBOB FUT (NYM) - Jun-2016	114	6,913,175	798,857	-
Gasoline RBOB FUT (NYM) - Jul-2016	58	3,933,166	-	(244)
Gold (CMX) - Jun-2016	96	11,858,190	299,250	-
Gold (CMX) - Aug-2016	52	6,596,200	-	(1,040)
Heating Oil (NYM) - Jun-2016	86	4,269,002	815,611	-
Heating Oil (NYM) - Jul-2016	40	2,378,544	-	-
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jun-2016	569	11,693,630	130,190	-
Henry Hub Natural Gas (NYM) - Jul-2016	281	6,330,930	-	-
Lean Hogs (CME) - Jun-2016	108	3,489,850	-	(370)
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Jun-2016	966	37,939,350	6,525,630	-
Light Sweet Crude Oil (NYM) - Jul-2016	449	21,044,630	-	-
Live Cattle (CME) - Jun-2016	95	4,782,760	-	(420,360)
Live Cattle (CME) - Aug-2016	57	2,547,900	-	-

Lumber (CME) - Jul-2016	108	3,673,956	-	(660)
Milk Future (CME) - May-2016	9	251,680	-	(13,900)
Milk Future (CME) - Jun-2016	5	133,500	-	-
Oat (CBT) - Jul-2016	182	1,781,763	99,663	-
Palladium (NYM) - Jun-2016	12	613,295	135,925	-
Palladium (NYM) - Sep-2016	6	374,910	270	-
Platinum (NYM) - Jul-2016	134	6,260,340	779,350	-
Rough Rice (CBT) - Jul-2016	130	2,627,390	233,910	-
Silver (CMX) - Jul-2016	185	14,174,345	2,094,555	-
Soybean Meal (CBT) - Jul-2016	95	2,612,540	554,760	-
Soybean Oil (CBT) - Jul-2016	360	7,412,724	-	(226,404)
Soybeans (CBT) - Jul-2016	269	12,390,800	1,429,075	-
Sugar No. 11 World (NYB) Jul-2016	207	3,595,469	46,738	-
Wheat (CBT) - Jul-2016	151	3,643,425	-	(60,950)
Wheat (CBT) - Jul-2016	723	17,266,075	284,750	-
		234,864,627	16,922,709	(1,021,326)
先物契約合計		364,268,896	29,056,241	(3,423,647)

投資明細

2016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 GOVT OPCT 27APR17	46,000,000.00	45,929,966.56	
TREASURY BILL US GOVT OPCT 22JUN17	40,000,000.00	39,891,224.81	
US T-BILL OPCT 05JAN17	38,000,000.00	37,991,805.14	
TREASURY BILL US GOV OPCT 20JUL17	38,000,000.00	37,872,288.13	
US TBILL OPCT 2FEB17	36,000,000.00	35,977,735.47	
TREASURY BILL US GOVT OPCT 25MAY17	36,000,000.00	35,928,234.00	
TREASURY BILL US GOVT OPCT 14SEP17	35,000,000.00	34,821,519.45	
US T-BILL 30MAR17	34,000,000.00	33,962,458.85	
US T-BILL OPCT 16FEB17	25,000,000.00	24,982,870.54	
TREASURY BILL US GOVT OPCT 02MAR17	24,000,000.00	23,971,400.67	
TREASURY BILL US GOVT OPCT 17AUG17	24,000,000.00	23,912,998.16	

(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-17	買建	454	-115,002.77	
RAPESEED EURO FUT (EOP) FEB-17	買建	190	373,246.89	
BRENT CRUDE OIL (ICE) MAR-17	買建	1054	4,958,910.00	
COFFEE ROBUSTA (ICE) MAR-17	買建	394	116,520.00	

COPPER GRADE A (LME) DEC-16	買建	137	2,858,700.00
COPPER GRADE A (LME) DEC-16	売建	137	-2,774,593.75
COPPER GRADE A (LME) JAN-17	買建	139	2,814,250.00
COPPER GRADE A (LME) JAN-17	売建	139	300,293.75
COPPER GRADE A (LME) FEB-17	買建	110	-237,831.25
GAS OIL (ICE) FEB-17	買建	109	413,550.00
NO 7 COCOA (ICE) MAR-17	買建	165	-755,476.35
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-16	買建	395	733,656.25
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) DEC-16	売建	395	-205,418.75
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-17	買建	391	88,312.50
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) JAN-17	売建	391	-175,493.75
PRIMARY HIGH GRADE ALUMINIUM (LME) FEB-17	買建	371	145,737.50
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-16	買建	64	342,945.00
PRIMARY NICKEL (LME) DEC-16	売建	64	-354,811.50
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-17	買建	67	371,544.00
PRIMARY NICKEL (LME) JAN-17	売建	67	-81,702.00
PRIMARY NICKEL (LME) FEB-17	買建	58	71,070.00
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-16	買建	141	1,084,887.50
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) DEC-16	売建	141	-883,012.50
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-17	買建	140	888,950.00
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) JAN-17	売建	140	30,487.50
SPECIAL HIGH GRADE ZINC (LME) FEB-17	買建	112	-25,750.00
STANDARD LEAD (LME) DEC-16	買建	165	894,200.00
STANDARD LEAD (LME) DEC-16	売建	165	-1,030,650.00
STANDARD LEAD (LME) JAN-17	買建	162	1,012,725.00
STANDARD LEAD (LME) JAN-17	売建	162	90,850.00
STANDARD LEAD (LME) FEB-17	買建	129	-70,362.50
TIN (LME) DEC-16	買建	42	299,250.00
TIN (LME) DEC-16	売建	42	-131,600.00
TIN (LME) JAN-17	買建	41	130,425.00
TIN (LME) JAN-17	売建	41	-86,925.00
TIN (LME) FEB-17	買建	38	85,350.00
WHITE SUGAR (ICE) MAR-17	買建	153	-523,790.00
RUBBER (TCM) MAY-17	買建	374	515,506.40
CORN (CBT) MAR-17	買建	1075	-12,287.50
COTTON NO 2 (NYB) MAR-17	買建	473	549,930.00
FROZEN CONCENTRATED ORANGE JUICE (NYB) MAR-17	買建	77	-180,960.00
GASOLINE RBOB FUT (NYM) FEB-17	買建	203	791,065.80
GOLD (CMX) FEB-17	買建	170	-2,034,390.00
HEATING OIL (NYM) FEB-17	買建	113	533,009.40
HENRY HUB NATURAL GAS (NYM) FEB-17	買建	606	445,860.00
LEAN HOGS (CME) FEB-17	買建	182	580,210.00
LIGHT SWEET CRUDE OIL (NYM) FEB-17	買建	1351	6,083,840.00
LIVE CATTLE (CME) FEB-17	買建	183	644,010.00
LUMBER (CME) MAR-17	買建	106	-179,487.00
MILK FUTURE (CME) JAN-17	買建	12	13,040.00
OAT (CBT) MAR-17	買建	187	129,537.50
PALLADIUM (NYM) MAR-17	買建	16	167,300.00

PLATINUM (NYM) APR-17	買建	157	175,170.00	
ROUGH RICE (CBT) MAR-17	買建	155	44,050.00	
SILVER (CMX) MAR-17	買建	194	-1,054,145.00	
SOYBEAN MEAL (CBT) MAR-17	買建	92	-13,810.00	
SOYBEAN OIL (CBT) MAR-17	買建	363	-80,796.00	
SOYBEANS (CBT) MAR-17	買建	267	-58,425.00	
SUGAR NO 11 WORLD (NYB) MAR-17	買建	181	-389,188.80	
WHEAT (CBT) MAR-17	買建	924	-609,925.00	
WHEAT (CBT) MAR-17	買建	188	-148,975.00	

(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28年6月16日から平成28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28年12月15日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,477,246,119
投資信託受益証券		87,955,120,933
投資証券		31,030,820,103
未収入金		47,000,000
流動資産合計		120,510,187,155
資産合計		120,510,187,155
負債の部		
流動負債		
未払解約金		149,305,615
未払受託者報酬		26,047,493
未払委託者報酬		260,475,369
その他未払費用		1,047,133
流動負債合計		436,875,610
負債合計		436,875,610
純資産の部		
元本等		
元本	1	121,391,778,755
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	2	1,318,467,210
（分配準備積立金）		1,017,537,020
元本等合計		120,073,311,545
純資産合計		120,073,311,545
負債純資産合計		120,510,187,155

[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28年6月16日 至 平成28年12月15日
	金額(円)
営業収益	
有価証券売買等損益	620,735,349
営業収益合計	620,735,349
営業費用	
支払利息	350,008
受託者報酬	26,047,493
委託者報酬	260,475,369
その他費用	1,047,287
営業費用合計	287,920,157
営業損失()	908,655,506
経常損失()	908,655,506
中間純損失()	908,655,506
一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	84,300,176
期首剰余金又は期首欠損金()	406,279,615
剰余金増加額又は欠損金減少額	52,183,823
中間一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	52,183,823
剰余金減少額又は欠損金増加額	140,016,088
中間追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	140,016,088
中間剰余金又は中間欠損金()	1,318,467,210

[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28年6月16日 至 平成28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28年12月15日現在
1. 1期首元本額	118,611,166,437円
期中追加設定元本額	17,034,130,819円
期中一部解約元本額	14,253,518,501円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	121,391,778,755口
3. 2元本の欠損	中間貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は1,318,467,210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28年6月16日 至 平成28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28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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額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28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28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)	0.9891円 (9,891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28年12月30日

資産総額	267,823,967,713円
負債総額	1,734,863,521円
純資産総額（ - ）	266,089,104,192円
発行済数量	201,381,415,632口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3213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28年12月30日

資産総額	172,201,592,796円
負債総額	33,814,817円
純資産総額（ - ）	172,167,777,979円
発行済数量	148,669,231,364口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1581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28年12月30日

資産総額	119,663,591,966円
負債総額	23,720,816円
純資産総額（ - ）	119,639,871,150円
発行済数量	110,443,372,552口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0833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28年12月30日

資産総額	406,500,489,139円
負債総額	2,419,838,207円
純資産総額（ - ）	404,080,650,932円

発行済数量	350,934,448,771口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1514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28年12月30日

資産総額	105,713,945,059円
負債総額	20,841,847円
純資産総額（ - ）	105,693,103,212円
発行済数量	92,604,367,015口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1413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28年12月30日

資産総額	47,612,382,097円
負債総額	9,434,849円
純資産総額（ - ）	47,602,947,248円
発行済数量	38,603,417,417口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2331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28年12月30日

資産総額	71,844,957,843円
負債総額	457,456,546円
純資産総額（ - ）	71,387,501,297円
発行済数量	42,880,365,519口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.6648円

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

純資産額計算書

平成28年12月30日

資産総額	80,032,676,414円
負債総額	510,621,333円
純資産総額（ - ）	79,522,055,081円
発行済数量	32,246,777,847口

1 単位当たり純資産額（ / ） 2.4660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28年12月30日

資産総額	55,657,028,653円
負債総額	372,923,868円
純資産総額（ - ）	55,284,104,785円
発行済数量	36,161,116,617口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.5288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28年12月30日

資産総額	55,973,514,939円
負債総額	884,851,894円
純資産総額（ - ）	55,088,663,045円
発行済数量	35,525,028,393口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.5507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28年12月30日

資産総額	48,384,507,532円
負債総額	158,148,513円
純資産総額（ - ）	48,226,359,019円
発行済数量	103,020,016,559口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.4681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28年12月30日

資産総額	79,631,557,458円
負債総額	5,000,000,000円
純資産総額（ - ）	74,631,557,458円
発行済数量	73,210,460,386口

1 単位当たり純資産額（ / ）

1.0194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28年12月30日

資産総額	120,603,011,032円
負債総額	23,605,071円
純資産総額（ - ）	120,579,405,961円
発行済数量	121,806,259,607口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.9899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28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年間における資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

取締役会は、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28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	68	219,503
追加型株式投資信託	664	12,714,360
株式投資信託 合計	732	12,933,863
単位型公社債投資信託	14	97,869
追加型公社債投資信託	14	2,167,293
公社債投資信託 合計	28	2,265,162
総合計	760	15,199,024

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57期事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第58期事業年度に係る中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）の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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,438	31,715
有価証券	4,878	1,137
前払費用	139	159
未収委託者報酬	10,295	9,896
未収収益	110	87
繰延税金資産	585	468
その他	153	83
流動資産計	47,600	43,547
固定資産		
有形固定資産	1	243
建物	21	18

器具備品	234	224
無形固定資産	2,759	2,706
ソフトウェア	2,758	2,385
ソフトウェア仮勘定	1	321
投資その他の資産	12,979	14,223
投資有価証券	6,667	7,872
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	124	123
長期差入保証金	996	1,049
その他	60	47
固定資産計	15,995	17,173
資産合計	63,596	60,720

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	64	61
未払金	9,172	8,789
未払収益分配金	5	5
未払償還金	72	63
未払手数料	4,965	4,330
その他未払金	2 4,127	2 4,390
未払費用	4,162	4,215
未払法人税等	1,133	1,155
未払消費税等	1,429	538
賞与引当金	1,092	937
その他	747	22
流動負債計	17,801	15,720
固定負債		
退職給付引当金	2,072	2,209
役員退職慰労引当金	101	93
繰延税金負債	1,745	1,410
その他	2	-
固定負債計	3,920	3,714
負債合計	21,722	19,435

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	14,126	13,960
利益剰余金合計	14,501	14,334
株主資本合計	41,171	41,004
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	702	280
評価・換算差額等合計	702	280
純資産合計	41,873	41,284
負債・純資産合計	63,596	60,720

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	90,924	88,850
その他営業収益	933	799
営業収益計	91,858	89,650
営業費用		
支払手数料	49,978	46,165
広告宣伝費	670	646
調査費	9,013	10,116
調査費	867	925
委託調査費	8,146	9,191
委託計算費	756	761
営業雑経費	1,289	1,346
通信費	252	249
印刷費	481	515
協会費	53	53
諸会費	13	14

その他営業雑経費	488	513
営業費用計	61,709	59,036
一般管理費		
給料	5,881	5,797
役員報酬	289	354
給料・手当	3,803	3,850
賞与	695	654
賞与引当金繰入額	1,092	937
福利厚生費	831	837
交際費	45	70
旅費交通費	176	211
租税公課	259	325
不動産賃借料	1,180	1,258
退職給付費用	383	394
役員退職慰労引当金繰入額	38	37
固定資産減価償却費	1,032	1,110
諸経費	1,372	1,486
一般管理費計	11,201	11,531
営業利益	18,948	19,082

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金	1	1,226	1	109
受取利息		20		25
投資有価証券売却益		145		115
外国税関連費用引当金戻入益		-		171
その他		226		73
営業外収益計		1,620		496
営業外費用				
投資有価証券売却損		84		14
その他		67		94
営業外費用計		152		108
経常利益		20,416		19,471
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	26	-
特別損失計	772	-
税引前当期純利益	19,651	19,471
法人税、住民税及び事業税	6,238	6,215
法人税等調整額	17	6
法人税等合計	6,220	6,209
当期純利益	13,431	13,262

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		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		
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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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	14,126	14,501	41,171
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,428	△13,428	△13,428
当期純利益	-	-	-	13,262	13,262	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△166	△166	△166
当期末残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004

	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
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△13,428
当期純利益	-	-	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△422	△422	△422
当期変動額合計	△422	△422	△589
当期末残高	280	280	41,284

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

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	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) 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。

(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。

(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)

(損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「投資有価証券売却益」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。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」の「その他」に表示していた372百万円は、「投資有価証券売却益」145百万円、「その他」226百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	20百万円	23百万円
器具備品	275百万円	232百万円

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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
未払金	4,084百万円	4,320百万円

3 保証債務

前事業年度（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。

当事業年度（平成28年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,749百万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26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
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

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(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

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

平成28年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	13,262百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	5,084円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月24日

(金融商品関係)

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、「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、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、

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 その他有価証券	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。

当事業年度（平成28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	31,715	31,715	-
(2) 未収委託者報酬	9,896	9,896	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	7,987	7,987	-
資産計	49,599	49,599	-
(1) 未払手数料	4,330	4,330	-
(2) その他未払金	4,390	4,390	-
(3) 未払費用(*)	3,420	3,420	-
負債計	12,141	12,141	-

(*) 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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,025	1,021
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	996	1,049

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

当事業年度（平成28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	31,715	-	-	-
未収委託者報酬	9,896	-	-	-
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	1,115	4,570	1,712	141
合計	42,727	4,570	1,712	141

（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。

当事業年度（平成28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。

当事業年度(平成28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	141	55	86
(2) その他 証券投資信託	3,875	3,408	466
小計	4,016	3,463	553
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	3,970	4,119	148
小計	3,970	4,119	148
合計	7,987	7,583	404

(注) 非上場株式(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。

3. 売却したその他有価証券

前事業年度(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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28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	3	-	0
(2) その他 証券投資信託	19,069	115	13
合計	19,072	115	14

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、証券投資信託について4百万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いません。

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 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,959百万円	2,072百万円
勤務費用	212	222
退職給付の支払額	118	120
その他	18	35
退職給付債務の期末残高	2,072	2,209

(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 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,072百万円	2,209百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,072	2,209
退職給付引当金	2,072	2,209
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,072	2,209

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)
勤務費用	212百万円	222百万円
確定給付制度に係る退職給付費用	212	222

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170百万円、当事業年度172百万円であります。

(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 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	670	676
賞与引当金	305	225
外国税関連費用	241	-
未払事業税	231	224
連結法人間取引(譲渡損)	128	121
投資有価証券評価損	105	95
出資金評価損	103	98
その他	206	173
繰延税金資産小計	1,992	1,615
評価性引当額	613	347
繰延税金資産合計	1,379	1,268
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,203	2,086
その他有価証券評価差額金	335	124
繰延税金負債合計	2,539	2,210
繰延税金負債の純額	1,159	941

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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
法定実効税率	35.64%	33.06%
(調整)		
交際費等永久に損金に算入されない項目	1.14%	0.77%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	2.02%	0.02%
評価性引当額の増減額	2.67%	1.29%
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.51%	0.19%
その他	0.07%	0.43%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.65%	31.89%

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28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29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30.86%に、平成30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30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産（流動）が24百万円、繰延税金負債（長期）が74百万円、法人税等調整額が50百万円、それぞれ減少し、その他有価証券評価差額金が6百万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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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)	1,749	-	-

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) (注1)	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 (注2)	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(注3)	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(注4)	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27年4月1日 至 平成28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) (注1)	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(注2)	27,062	未払手数料	3,188
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(注3)	593	未払費用	252
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(注4)	1,028	長期差入保証金	1,027

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26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,052.69円	1株当たり純資産額	15,826.85円
1株当たり当期純利益	5,148.94円	1株当たり当期純利益	5,084.10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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益(百万円)	13,431	13,262
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28年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		22,153
有価証券		529
未収委託者報酬		9,521
繰延税金資産		428
その他		351
流動資産合計		32,984
固定資産		
有形固定資産	1	241
無形固定資産		
ソフトウェア		2,212
その他		252
無形固定資産合計		2,465
投資その他の資産		
投資有価証券		7,003
関係会社株式		5,129
その他		1,296
投資その他の資産合計		13,430
固定資産合計		16,137
資産合計		49,121

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (平成28年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		7,144
未払費用		3,762
未払法人税等		1,205
賞与引当金		733
その他	3	434
流動負債合計		13,279
固定負債		
退職給付引当金		2,301
役員退職慰労引当金		122
その他		9
固定負債合計		2,432
負債合計		15,712
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		6,184
利益剰余金合計		6,559
株主資本合計		33,229
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		179
評価・換算差額等合計		179
純資産合計		33,408
負債・純資産合計		49,121

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		39,705
その他営業収益		356
営業収益合計		40,062
営業費用		
支払手数料		20,125
その他営業費用		5,997
営業費用合計		26,122
一般管理費	1	5,754
営業利益		8,184
営業外収益	2	165
営業外費用	3	59
経常利益		8,290
特別利益		-
特別損失	4	260
税引前中間純利益		8,029
法人税、住民税及び事業税		3,936
法人税等調整額		1,393
中間純利益		5,486

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

	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	13,960	14,334	41,004
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 13,261	△ 13,261	△ 13,261
中間純利益	-	-	-	5,486	5,486	5,486
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	-	-	-	△ 7,775	△ 7,775	△ 7,775
当中間期末残高	15,174	11,495	374	6,184	6,559	33,229

	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	280	280	41,284
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 13,261
中間純利益	-	-	5,486
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	△ 100	△ 100	△ 100
当中間期変動額合計	△ 100	△ 100	△ 7,875
当中間期末残高	179	179	33,408

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

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。

ただし、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）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28年9月30日現在)
有形固定資産	273百万円

２ 保証債務

当中間会計期間（平成28年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,554百万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28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	528百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
受取配当金	62百万円
投資有価証券売却益	53百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
為替差損	23百万円
投資有価証券売却損	16百万円

4 特別損失の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
MMF等償還関連費用	260百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28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28年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成28年 3月31日	平成28年 6月24日

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成28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	22,153	22,153	-
(2) 未収委託者報酬	9,521	9,521	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,511	6,511	-
資産合計	38,186	38,186	-
(1) 未払金	7,144	7,144	-
(2) 未払費用(*)	3,762	3,762	-
負債合計	10,906	10,906	-

(*) 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	1,051

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28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	111	55	56
(2) その他			
証券投資信託	3,994	3,627	366
小計	4,105	3,682	422
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	2,406	2,569	163
小計	2,406	2,569	163
合計	6,511	6,252	259

(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28年4月1日 至 平成28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28年4月1日 至 平成28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28年4月1日 至 平成28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28年4月1日 至 平成28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28年4月1日 至 平成28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28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
1株当たり純資産額	12,807.54円
1株当たり中間純利益金額	2,103.26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いません。

(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28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
中間純利益(百万円)	5,486
普通株式に係る中間純利益(百万円)	5,486
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。）。

通常の実取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）又は子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行なうこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行なう投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

提出日前1年以内において、定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項に該当する事実はありません。

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼ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29年1月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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28年6月16日から平成28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28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28年6月16日から平成28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29年1月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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28年6月16日から平成28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28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28年6月16日から平成28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29年1月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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28年6月16日から平成28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28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28年6月16日から平成28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29年1月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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28年6月16日から平成28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28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28年6月16日から平成28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29年1月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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28年6月16日から平成28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28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28年6月16日から平成28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29年1月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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28年6月16日から平成28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28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28年6月16日から平成28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29年1月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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28年6月16日から平成28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28年12月15日現在の信託財産の状況及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年6月16日から平成28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29年1月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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28年6月16日から平成28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28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28年6月16日から平成28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29年1月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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28年6月16日から平成28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28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28年6月16日から平成28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29年1月27日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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28年6月16日から平成28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28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28年6月16日から平成28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28年 5月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第57期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成28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28年11月24日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の中間会計期間（平成28年4月1日から平成28年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的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28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28年4月1日から平成28年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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。