

**【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27年1月30日提出

**【発行者名】** 大和証券投資信託委託株式会社

**【代表者の役職氏名】** 取締役社長 白川 真

**【本店の所在の場所】** 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

**【事務連絡者氏名】** 山部 努  
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

**【電話番号】** 03-5555-3111

**【届出の対象とした募集内  
国投資信託受益証券に係る  
ファンドの名称】** スマート・ミックス・Dガード（為替ヘッジなし）

**【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26年8月2日から平成27年7月31日ま  
で）  
10兆円を上限とします。

**【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26年8月1日付で提出した有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項を、半期報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

（ 下線部 \_\_\_\_\_ は訂正部分を示します。 ）

## 第二部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成26年5月末日現在） >

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成26年11月末日現在） >

< 略 >

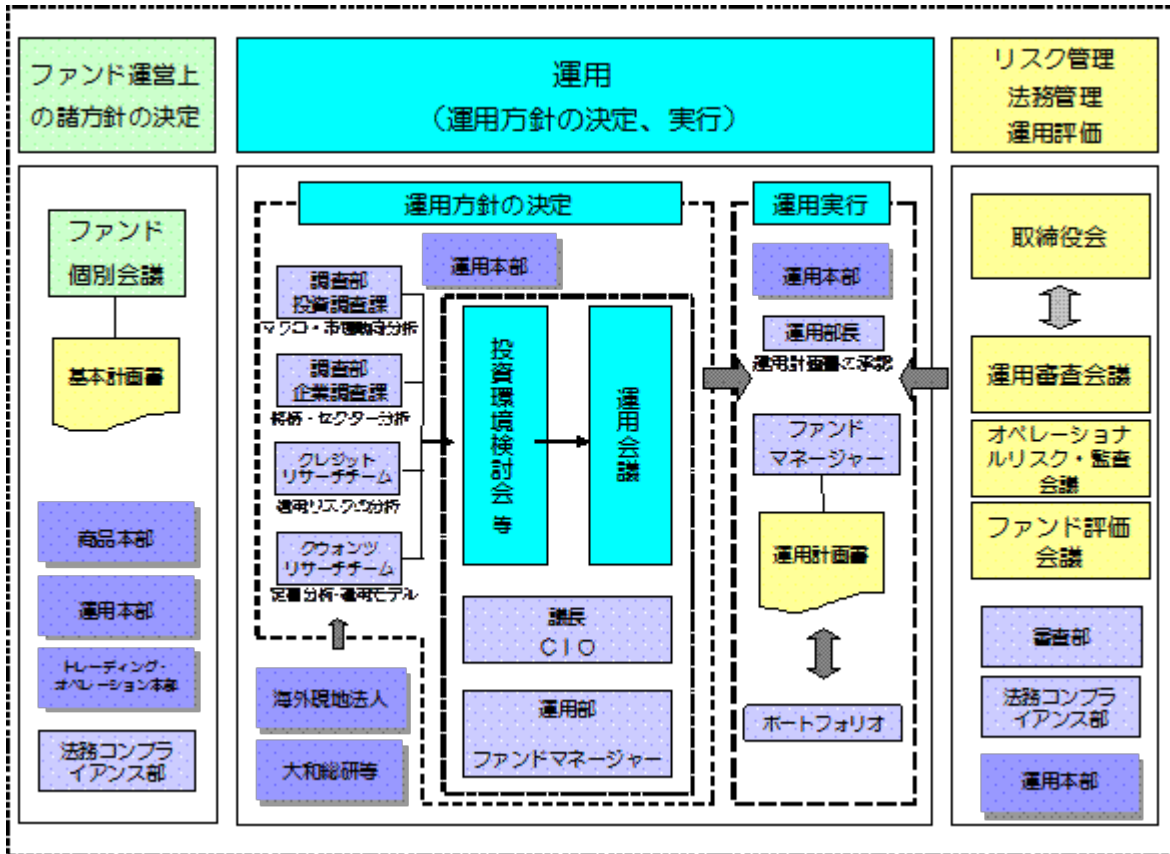
#### 2 【投資方針】

##### (3) 【運用体制】

< 訂正前 >

運用体制

< 略 >



< 略 >

#### ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク・監査会議

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

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

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

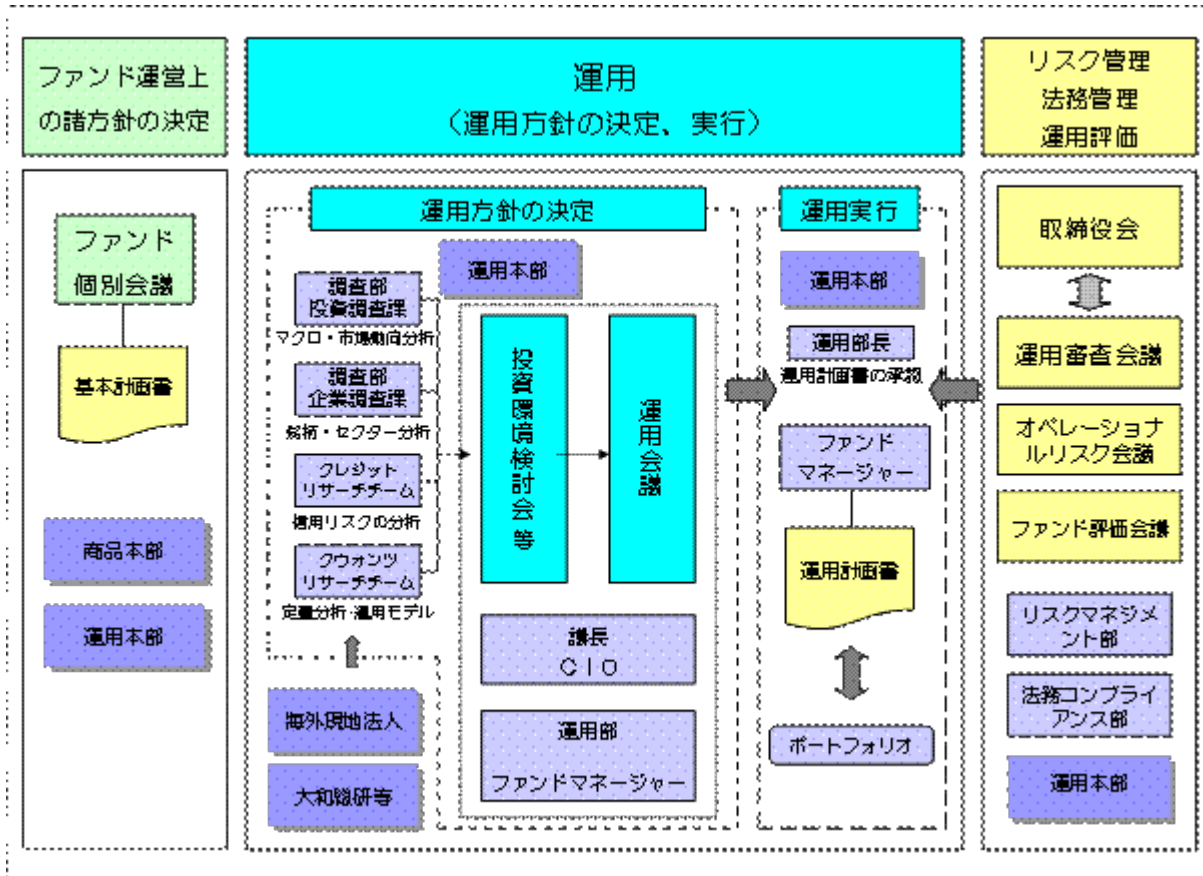
< 略 >

上記の運用体制は平成26年5月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

< 訂正後 >

運用体制

< 略 >



< 略 >

#### ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク会議

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

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

これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は15～25名程度です。

< 略 >

上記の運用体制は平成26年11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】

< 訂正前 >

< 略 >

金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

< 略 >

チ・委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

― 同一銘柄の転換社債等（信託約款）

< 略 >

\_\_\_ 有価証券の貸付け（信託約款）

< 略 >

\_\_\_ 外貨建資産（信託約款）

< 略 >

\_\_\_ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

< 略 >

\_\_\_ 外国為替予約取引（信託約款）

< 略 >

\_\_\_ 資金の借入れ（信託約款）

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

金利先渡取引および為替先渡取引（信託約款）

< 略 >

チ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

デリバティブ取引等（信託約款）

委託会社は、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ることとなる投資の指図をしません。

\_\_\_ 同一銘柄の転換社債等（信託約款）

< 略 >

\_\_\_ 有価証券の貸付け（信託約款）

< 略 >

\_\_\_ 外貨建資産（信託約款）

< 略 >

\_\_\_ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

< 略 >

\_\_\_ 外国為替予約取引（信託約款）

< 略 >

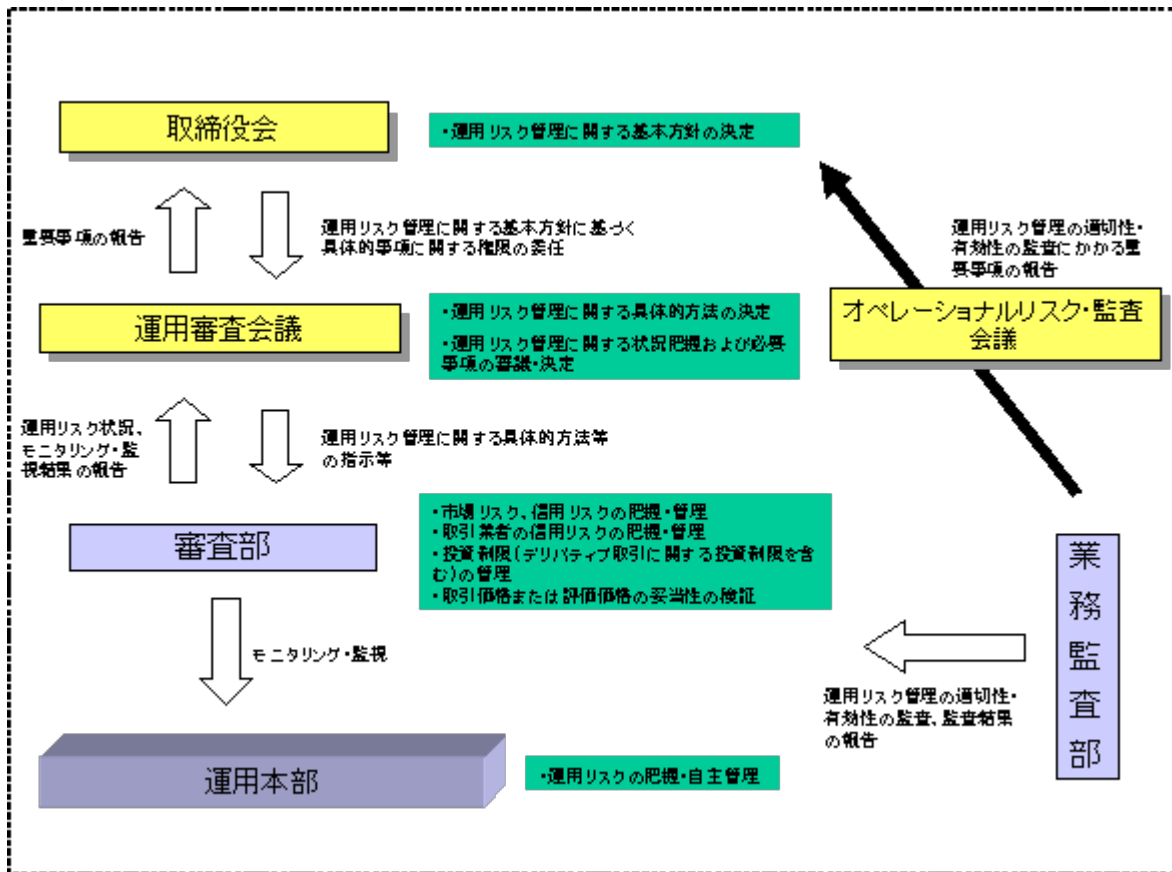
\_\_\_ 資金の借入れ（信託約款）

< 略 >

### 3 【投資リスク】

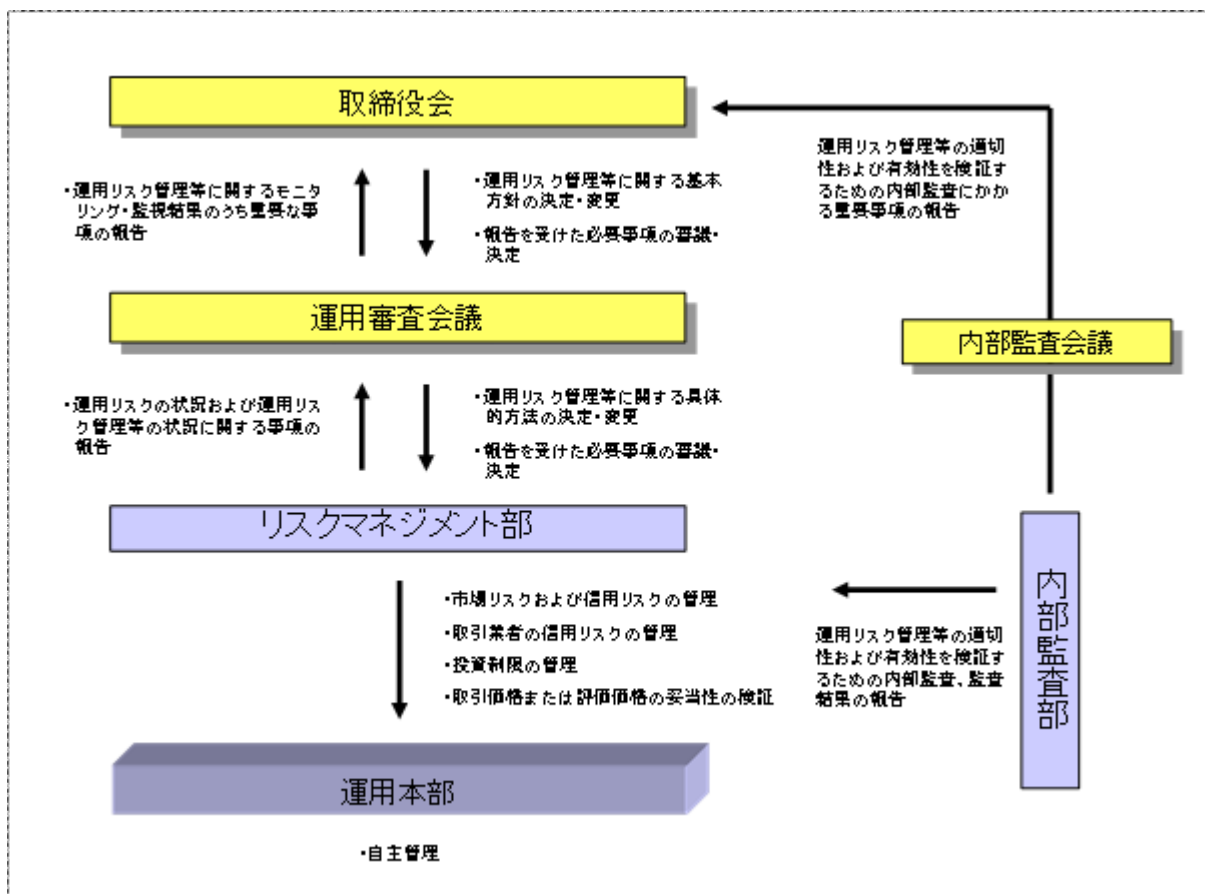
(4) リスク管理体制

< 訂正前 >



## &lt;訂正後&gt;

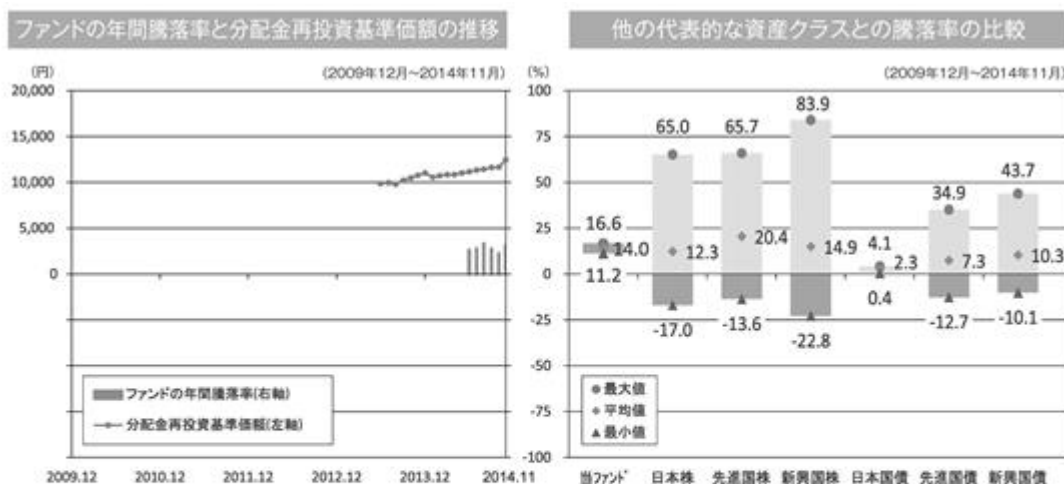
運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



当社では、運用リスクのうち、大量の解約・換金によって必要となる資金の確保のために合理的な条件での取引が困難となるリスク、および市場の混乱、取引所における休業、取引の停止等により市場において取引ができないまたは合理的な条件での取引が困難となるリスクを「流動性リスク」とし、当社の運用する信託財産における流動性リスクの防止および流動性リスク発生時における円滑な事務遂行を目的とした事前対策、ならびに流動性リスク発生時における対応策（コンティンジェンシー・プラン）を定めています。

## 参考情報

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



- ※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。●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、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2014, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4 【手数料等及び税金】



## (1) 【申込手数料】

&lt; 訂正前 &gt;

&lt; 略 &gt;

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

&lt; 訂正後 &gt;

&lt; 略 &gt;

「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

申込手数料は、お買付時の商品説明または商品情報の提供、投資情報の提供、取引執行等の対価です。  
くわしくは販売会社にお問合わせ下さい。

## (3) 【信託報酬等】

&lt; 訂正前 &gt;

&lt; 略 &gt;

前 の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

&lt; 訂正後 &gt;

&lt; 略 &gt;

前 の販売会社への配分は、販売会社の行なう業務に対する代行手数料であり、委託会社が一旦信託財産から収受した後、販売会社に支払われます。

信託報酬を対価とする役務の内容は、配分先に応じて、それぞれ以下のとおりです。

委託会社：ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価

販売会社：運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

## (5) 【課税上の取扱い】

&lt; 訂正前 &gt;

&lt; 略 &gt;

( ) 上記は、平成26年5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。

&lt; 略 &gt;

&lt; 訂正後 &gt;

&lt; 略 &gt;

（ ）上記は、平成26年11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>

## (1) 【投資状況】（平成26年11月28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	42,483,767	99.22
内 日本	42,483,767	99.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	335,074	0.78
純資産総額	42,818,841	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26年11月28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	新興国株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,573,272	1.1372 6,338,477	1.2836 7,153,851	16.71
2	先進国株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	4,853,115	1.2399 6,017,807	1.4727 7,147,182	16.69
3	国内株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,509,989	1.1068 6,098,458	1.2929 7,123,864	16.64
4	新興国債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,687,579	1.0836 6,163,590	1.2447 7,079,329	16.53
5	先進国債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,600,516	1.1160 6,250,628	1.2582 7,046,569	16.46
6	国内債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	6,638,235	1.0256 6,808,443	1.0444 6,932,972	16.19

(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	99.22%
合計	99.22%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (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)
平成25年11月末日	24,461,039	-	1.0779	-
12月末日	25,612,874	-	1.1024	-
平成26年1月末日	13,694,550	-	1.0557	-
2月末日	17,192,389	-	1.0720	-
3月末日	19,203,095	-	1.0851	-
4月末日	22,291,120	-	1.0851	-
第1計算期間末 (平成26年5月8日)	23,326,761	23,326,761	1.0861	1.0861
5月末日	25,780,706	-	1.1028	-
6月末日	29,171,062	-	1.1157	-
7月末日	31,187,867	-	1.1342	-
8月末日	31,741,195	-	1.1430	-
9月末日	41,289,004	-	1.1625	-
10月末日	39,498,129	-	1.1666	-
11月末日	42,818,841	-	1.2475	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000
平成26年5月9日～ 平成26年11月8日	-

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	8.6
平成26年5月9日～ 平成26年11月8日	10.9

## (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	56,888,148	38,410,699
平成26年5月9日～ 平成26年11月8日	15,973,919	3,421,329

(注) 当初設定数量は3,000,000口です。

(参考) マザーファンド  
国内株式マザーファンド

(1) 投資状況（平成26年11月28日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	115,081,810	64.48
内 日本	115,081,810	64.48
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	63,400,019	35.52
純資産総額	178,481,829	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(%)
株価指数先物取引(買建)	179,133,500	100.37
内 日本	179,133,500	100.37

(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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(2) 投資資産（平成26年11月28日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	324 2年国債	日本	国債証券	21,000,000	100.02 21,005,670	100.01 21,002,520	0.100000 2015/01/15	11.77
2	330 2年国債	日本	国債証券	20,000,000	100.11 20,023,000	100.12 20,024,600	0.200000 2015/07/15	11.22
3	332 2年国債	日本	国債証券	20,000,000	100.07 20,014,800	100.07 20,015,600	0.100000 2015/09/15	11.21
4	323 2年国債	日本	国債証券	16,000,000	100.02 16,003,680	100.00 16,000,480	0.100000 2014/12/15	8.96
5	329 2年国債	日本	国債証券	15,000,000	100.12 15,018,000	100.10 15,015,900	0.200000 2015/06/15	8.41
6	88 5年国債	日本	国債証券	13,000,000	100.37 13,048,230	100.14 13,019,110	0.500000 2015/03/20	7.29
7	327 2年国債	日本	国債証券	10,000,000	100.02 10,002,700	100.03 10,003,600	0.100000 2015/04/15	5.60

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	64.48%

合計	64.48%
----	--------

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	ミニTOPIX先物 2014年12 月	買建	127	165,905,963	179,133,500	100.37%

(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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

#### 先進国株式マザーファンド

##### (1) 投資状況 (平成26年11月28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	51,553,482	50.72
内 アメリカ	51,553,482	50.72
投資証券	37,798,172	37.19
内 アイルランド	27,791,989	27.34
内 アメリカ	10,006,183	9.84
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,288,317	12.09
純資産総額	101,639,971	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(%)
株価指数先物取引(買建)	12,250,106	12.05
内 アメリカ	12,250,106	12.05
為替予約取引(買建)	6,381,720	6.28
内 日本	6,381,720	6.28
為替予約取引(売建)	1,368,495	1.35
内 日本	1,368,495	1.35

(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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(注4) 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26年11月28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	SPDR S&P 500 ETF TRUST	アメリカ	投資信託 受益証券	2,100	22,727.35 47,727,627	24,549.27 51,553,482	50.72
2	ISHARES MSCI EUROPE UCITS ET	アイルランド	投資証券	8,635	3,125.49 26,989,922	3,218.52 27,791,989	27.34
3	ISHARES MSCI PACIFIC EX JPN	アメリカ	投資証券	950	5,727.77 5,441,486	5,604.10 5,323,897	5.24
4	ISHARES MSCI CANADA ETF	アメリカ	投資証券	1,280	3,632.49 4,649,817	3,658.03 4,682,286	4.61

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	50.72%
投資証券	37.19%
合計	87.91%

(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
株価指数先物 取引	アメリカ	S&P500 E-MINI FUTURE 2014年12月	買建	1	11,645,980	12,250,106	12.05%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2014年12 月	買建	54,000	5,898,254	6,381,720	6.28%
		ユーロ売/円買 2014年12 月	売建	9,300	1,276,022	1,368,495	1.35%

(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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日も最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(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。

(注4) 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。

## 新興国株式マザーファンド

## (1) 投資状況(平成26年11月28日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	2,009,243,627	79.36
内 韓国	322,204,405	12.73
内 中国	450,686,442	17.80
内 台湾	252,705,558	9.98
内 香港	1,392,020	0.05
内 タイ	55,486,458	2.19
内 マレーシア	83,524,703	3.30
内 フィリピン	27,005,102	1.07
内 インドネシア	59,321,375	2.34
内 ポーランド	37,424,251	1.48
内 ロシア	88,721,528	3.50
内 ハンガリー	4,073,912	0.16
内 ギリシャ	11,592,186	0.46
内 トルコ	40,122,471	1.58
内 チェコ	4,027,970	0.16
内 メキシコ	115,276,289	4.55
内 コロンビア	16,777,340	0.66
内 ペルー	11,281,152	0.45
内 チリ	29,397,554	1.16
内 ブラジル	217,383,349	8.59
内 エジプト	5,858,858	0.23
内 南アフリカ	174,980,704	6.91
投資信託受益証券	38,011,359	1.50
内 アメリカ	38,011,359	1.50
投資証券	95,781,516	3.78
内 トルコ	1,394,270	0.06
内 アメリカ	84,115,443	3.32
内 メキシコ	4,701,416	0.19
内 南アフリカ	5,570,387	0.22
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	388,914,608	15.36
純資産総額	2,531,951,110	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(%)
株価指数先物取引(買建)	392,704,492	15.51
内 シンガポール	182,119,127	7.19



	内 アメリカ	210,585,365	8.32
為替予約取引(買建)		196,091,328	7.74
	内 日本	196,091,328	7.74

(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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(注4) 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26年11月28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	種類	数業種は	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	ISHARES MSCI EMERGING MKT ET	アメリカ	投資証券	-	16,400	4,961.87 81,375,297	5,007.04 82,115,464	3.24
2	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	525	128,653.99 67,543,347	135,627.20 71,204,280	2.81
3	TSMC	台湾	株式	情報技術	110,000	468.30 51,513,980	534.80 58,828,000	2.32
4	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	情報技術	23,600	1,880.18 44,372,738	1,907.77 45,023,490	1.78
5	CHINA MOBILE LTD	中国	株式	電気通信 サービス	28,000	1,452.48 40,670,001	1,447.98 40,543,650	1.60
6	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	346,000	88.20 30,520,762	88.45 30,603,700	1.21
7	NASPERS LTD-N SHS	南アフリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	1,922	14,166.40 27,227,831	15,564.34 29,914,661	1.18
8	IND & COMM BANK OF CHINA-H	中国	株式	金融	335,000	78.75 26,385,784	78.99 26,463,325	1.05
9	ITAU UNIBANCO-PREF	ブラジル	株式	金融	13,200	1,815.02 23,958,488	1,808.77 23,875,772	0.94
10	AMERICA MOVIL-L	メキシコ	株式	電気通信 サービス	156,000	149.54 23,330,401	142.00 22,152,764	0.87
11	BANK OF CHINA LTD-H	中国	株式	金融	369,000	55.67 20,550,008	58.86 21,721,185	0.86
12	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	58,000	381.99 22,155,801	370.92 21,513,476	0.85
13	ISHARES MSCI QATAR CP ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	-	6,500	3,135.81 20,383,014	3,080.48 20,023,137	0.79
14	GAZPROM OAO-ADR	ロシア	株式	エネルギー	27,397	848.18 23,240,531	714.10 19,564,450	0.77
15	MTN GROUP LTD	南アフリカ	株式	電気通信 サービス	7,741	2,704.62 20,936,532	2,429.82 18,809,261	0.74
16	BANCO BRADESCO PREF-ADR	ブラジル	株式	金融	9,600	1,949.37 18,715,100	1,923.60 18,466,580	0.73
17	AMBEV SA	ブラジル	株式	生活必需品	22,500	753.01 16,943,858	773.18 17,396,694	0.69

18	ISHARES MSCI UAE CAPPED ETF	アメリカ	投資信託 受益証券	-	6,100	2,891.66 17,639,844	2,643.62 16,126,099	0.64
19	CNOOC LTD	中国	株式	エネルギー	85,000	217.75 18,509,323	183.00 15,555,000	0.61
20	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国	株式	金融	36,000	353.83 12,738,115	411.75 14,823,000	0.59
21	HYUNDAI MOTOR CO	韓国	株式	一般消費 財・サービ ス	757	20,375.77 15,424,461	19,367.65 14,661,311	0.58
22	SK HYNIX INC	韓国	株式	情報技術	2,845	5,077.75 14,446,226	5,134.30 14,607,098	0.58
23	SASOL LTD	南アフリカ	株式	エネルギー	2,610	6,715.10 17,526,432	5,412.28 14,126,051	0.56
24	LUKOIL OAO-ADR	ロシア	株式	エネルギー	2,482	6,487.16 16,101,292	5,675.04 14,085,449	0.56
25	PETROCHINA CO LTD-H	中国	株式	エネルギー	104,000	162.32 16,881,775	132.67 13,798,200	0.54
26	PETROBRAS-PREF	ブラジル	株式	エネルギー	20,300	981.70 19,929,366	627.51 12,738,526	0.50
27	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	126,000	108.18 13,631,169	98.05 12,355,245	0.49
28	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	韓国	株式	金融	2,191	5,291.64 11,593,984	5,322.08 11,660,677	0.46
29	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	メキシコ	株式	一般消費 財・サービ ス	12,900	811.34 10,466,410	877.13 11,315,100	0.45
30	SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	韓国	株式	情報技術	102	100,708.77 10,272,295	110,519.00 11,272,938	0.45

(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
株式	79.36%
投資信託受益証券	1.50%
投資証券	3.78%
合計	84.64%

(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

業種	投資比率
エネルギー	7.08%
素材	6.26%
資本財・サービス	5.05%
一般消費財・サービス	7.49%
生活必需品	6.68%
ヘルスケア	1.55%
金融	22.38%
情報技術	13.56%
電気通信サービス	6.53%
公益事業	2.68%
その他	0.09%
合計	79.36%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

### 投資不動産物件

該当事項はありません。

### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物取引	アメリカ	MINI MSCI EMG MKT 2014年12月	買建	35	216,141,583	210,585,365	8.32%
	シンガポール	SGX MSCI TAIWAN 2014年12月	買建	5	20,096,144	20,276,445	0.80%
		SGX CNX NIFTY ETS 2014年12月	買建	80	161,523,934	161,842,682	6.39%
為替予約取引	日本	トルコ・リラ買/円売 2014年12月	買建	71,723	3,836,475	3,835,757	0.15%
		韓国ウォン買/円売 2014年12月	買建	167,469,980	17,927,661	17,969,528	0.71%
		米ドル買/円売 2014年12月	買建	1,020,000	116,235,564	120,574,700	4.76%
		南アフリカ・ランド買/円売 2014年12月	買建	1,007,535	10,835,036	10,831,006	0.43%
		ポーランド・ズロチ買/円売 2014年12月	買建	71,856	2,532,620	2,528,596	0.10%
		タイ・バーツ買/円売 2014年12月	買建	701,139	2,529,364	2,517,087	0.10%
		マレーシア・リングgit買/円売 2014年12月	買建	71,316	2,505,242	2,505,313	0.10%
		メキシコ・ペソ買/円売 2014年12月	買建	1,176,946	10,106,906	10,074,657	0.40%
		台湾ドル買/円売 2014年12月	買建	1,711,770	6,550,976	6,538,961	0.26%
		香港ドル買/円売 2014年12月	買建	1,228,066	18,728,003	18,715,723	0.74%

(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) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(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。

(注4) 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。

### 国内債券マザーファンド

#### (1) 投資状況 (平成26年11月28日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	810,183,410	98.44
内 日本	810,183,410	98.44
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,856,664	1.56
純資産総額	823,040,074	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26年11月28日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	345 2年国債	日本	国債証券	30,000,000	100.14 30,042,300	100.17 30,053,100	0.100000 2016/10/15	3.65
2	121 5年国債	日本	国債証券	20,000,000	99.86 19,973,600	100.00 20,000,000	0.100000 2019/09/20	2.43
3	335 10年国債	日本	国債証券	19,000,000	100.38 19,072,530	100.80 19,152,000	0.500000 2024/09/20	2.33
4	318 10年国債	日本	国債証券	18,000,000	105.28 18,951,580	105.57 19,004,220	1.000000 2021/09/20	2.31
5	110 5年国債	日本	国債証券	18,000,000	100.80 18,144,100	100.92 18,165,960	0.300000 2018/03/20	2.21
6	106 5年国債	日本	国債証券	18,000,000	100.34 18,062,480	100.53 18,095,580	0.200000 2017/09/20	2.20
7	338 2年国債	日本	国債証券	16,000,000	100.04 16,007,550	100.12 16,019,360	0.100000 2016/03/15	1.95
8	300 10年国債	日本	国債証券	10,000,000	106.28 10,628,720	106.14 10,614,700	1.500000 2019/03/20	1.29
9	342 2年国債	日本	国債証券	10,000,000	100.06 10,006,200	100.15 10,015,300	0.100000 2016/07/15	1.22
10	324 10年国債	日本	国債証券	9,000,000	103.48 9,313,830	104.19 9,377,100	0.800000 2022/06/20	1.14
11	328 10年国債	日本	国債証券	9,000,000	101.47 9,132,610	102.46 9,222,210	0.600000 2023/03/20	1.12
12	332 10年国債	日本	国債証券	9,000,000	100.34 9,030,840	102.14 9,193,320	0.600000 2023/12/20	1.12
13	115 5年国債	日本	国債証券	9,000,000	100.29 9,026,560	100.60 9,054,630	0.200000 2018/09/20	1.10
14	312 10年国債	日本	国債証券	8,000,000	106.21 8,497,100	106.45 8,516,320	1.200000 2020/12/20	1.03
15	305 10年国債	日本	国債証券	8,000,000	105.98 8,478,880	106.05 8,484,400	1.300000 2019/12/20	1.03
16	287 10年国債	日本	国債証券	8,000,000	105.57 8,446,000	104.82 8,386,160	1.900000 2017/06/20	1.02
17	331 10年国債	日本	国債証券	8,000,000	101.34 8,107,230	102.26 8,181,200	0.600000 2023/09/20	0.99
18	333 10年国債	日本	国債証券	8,000,000	100.72 8,057,770	102.02 8,161,680	0.600000 2024/03/20	0.99
19	94 5年国債	日本	国債証券	8,000,000	100.71 8,057,350	100.62 8,049,920	0.600000 2015/12/20	0.98
20	116 5年国債	日本	国債証券	8,000,000	100.18 8,015,160	100.58 8,046,800	0.200000 2018/12/20	0.98
21	105 5年国債	日本	国債証券	8,000,000	100.36 8,029,540	100.48 8,038,640	0.200000 2017/06/20	0.98

22	146 20年国債	日本	国債証券	7,000,000	107.85 7,550,120	109.77 7,684,180	1.700000 2033/09/20	0.93
23	1 30年国債	日本	国債証券	6,000,000	126.77 7,606,200	127.90 7,674,300	2.800000 2029/09/20	0.93
24	297 10年国債	日本	国債証券	7,000,000	105.59 7,391,930	105.43 7,380,380	1.400000 2018/12/20	0.90
25	329 10年国債	日本	国債証券	7,000,000	102.58 7,180,970	104.08 7,285,600	0.800000 2023/06/20	0.89
26	282 10年国債	日本	国債証券	7,000,000	103.80 7,266,140	103.05 7,213,500	1.700000 2016/09/20	0.88
27	101 5年国債	日本	国債証券	7,000,000	100.73 7,051,540	100.79 7,055,930	0.400000 2016/12/20	0.86
28	102 5年国債	日本	国債証券	7,000,000	100.53 7,037,150	100.59 7,041,580	0.300000 2016/12/20	0.86
29	307 10年国債	日本	国債証券	6,000,000	106.22 6,373,500	106.32 6,379,260	1.300000 2020/03/20	0.78
30	149 20年国債	日本	国債証券	6,000,000	102.02 6,121,490	105.58 6,335,160	1.500000 2034/06/20	0.77

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.44%
合計	98.44%

(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。

#### 先進国債券マザーファンド

#### (1) 投資状況 (平成26年11月28日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	188,715,822	94.48
内 ユーロ	82,883,709	41.50
内 マレーシア	871,486	0.44
内 ノルウェー	310,253	0.16
内 スウェーデン	585,369	0.29

内 デンマーク	1,529,762	0.77
内 イギリス	15,823,546	7.92
内 ポーランド	614,096	0.31
内 カナダ	3,739,221	1.87
内 アメリカ	77,225,216	38.66
内 メキシコ	1,588,569	0.80
内 南アフリカ	656,408	0.33
内 オーストラリア	2,888,187	1.45
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,021,477	5.52
純資産総額	199,737,299	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)	8,609,944	4.31
内 日本	8,609,944	4.31

(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26年11月28日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	109,000	99.10 12,771,730	99.66 12,843,253	0.625000 2017/05/31	6.43
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	80,000	99.42 9,403,635	100.42 9,498,976	1.500000 2019/03/31	4.76
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	40,000	106.25 5,024,775	107.57 5,087,578	3.125000 2021/05/15	2.55
4	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	31,000	110.62 5,047,994	110.17 5,027,642	4.750000 2017/05/01	2.52
5	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	21,000	120.18 3,715,189	127.72 3,948,111	4.250000 2022/09/28	1.98
6	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	20,000	121.28 3,570,630	129.87 3,823,520	4.250000 2023/10/25	1.91
7	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	20,000	116.81 3,438,974	127.12 3,742,560	5.000000 2040/09/01	1.87
8	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	21,000	115.53 3,571,409	118.16 3,652,623	3.500000 2020/07/15	1.83
9	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	30,000	98.85 3,506,247	99.25 3,520,298	0.750000 2017/12/31	1.76
10	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	18,000	118.12 3,129,931	121.17 3,210,520	3.750000 2021/04/25	1.61
11	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	15,000	128.21 2,830,876	140.70 3,106,744	6.000000 2029/01/31	1.56

12	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	20,000	100.73 2,965,638	101.53 2,989,131	0.500000 2017/10/13	1.50
13	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	14,000	100.48 2,612,741	111.52 2,899,765	3.250000 2044/01/22	1.45
14	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	15,000	120.93 2,670,134	126.63 2,796,189	5.500000 2021/04/30	1.40
15	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	24,000	90.07 2,555,754	98.50 2,794,957	2.875000 2043/05/15	1.40
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	23,000	96.84 2,633,470	97.71 2,657,235	1.125000 2019/12/31	1.33
17	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	12,000	112.28 2,502,607	114.07 2,542,346	4.500000 2019/03/07	1.27
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	20,000	99.98 2,364,316	100.30 2,371,693	0.625000 2016/10/15	1.19
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	20,000	100.12 2,367,461	100.21 2,369,660	0.375000 2016/02/15	1.19
20	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	15,000	104.47 2,306,830	104.44 2,306,079	2.750000 2016/11/15	1.15
21	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,000	121.81 2,160,381	129.28 2,292,733	4.500000 2036/02/15	1.15
22	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	19,000	100.48 2,257,158	100.69 2,262,072	0.875000 2016/11/30	1.13
23	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	13,000	113.91 2,179,799	117.69 2,252,288	3.000000 2022/04/25	1.13
24	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	10,000	132.44 1,949,516	150.53 2,215,919	4.750000 2035/04/25	1.11
25	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	13,000	112.59 2,154,648	114.68 2,194,669	3.750000 2021/08/01	1.10
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	18,000	100.53 2,139,468	102.90 2,189,983	2.500000 2023/08/15	1.10
27	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	8,000	134.70 2,001,426	146.35 2,174,526	6.000000 2028/12/07	1.09
28	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	13,000	111.99 2,143,205	113.31 2,168,472	2.250000 2021/09/04	1.09
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	18,000	98.02 2,086,151	100.41 2,136,865	2.000000 2021/11/15	1.07
30	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	ユーロ	国債証券	12,000	113.98 2,013,395	115.34 2,037,365	4.250000 2019/09/01	1.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	94.48%
合計	94.48%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2015年1月	買建	1,000	185,569	185,550	0.09%
		ユーロ買/円売 2014年12月	買建	10,071	1,418,837	1,482,388	0.74%
		米ドル買/円売 2015年1月	買建	5,900	697,105	697,085	0.35%
		豪ドル買/円売 2014年12月	買建	3,850	378,283	387,582	0.19%
		メキシコ・ペソ買/円売 2014年12月	買建	73,321	608,663	627,624	0.31%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2014年12月	買建	26,149	401,606	414,979	0.21%
		豪ドル買/円売 2015年1月	買建	500	50,181	50,175	0.03%
		カナダ・ドル買/円売 2014年12月	買建	8,575	855,178	893,462	0.45%
		ユーロ買/円売 2015年1月	買建	3,900	573,840	573,807	0.29%
		英ポンド買/円売 2014年 12月	買建	2,917	527,092	541,684	0.27%
		デンマーク・クローネ買/ 円売 2014年12月	買建	7,752	146,285	153,330	0.08%
		メキシコ・ペソ買/円売 2015年1月	買建	6,700	57,381	57,218	0.03%
		ノルウェー・クローネ買/ 円売 2014年12月	買建	14,380	240,170	244,463	0.12%
		スイス・フラン買/円売 2014年12月	買建	4,700	554,187	575,750	0.29%
		南アフリカ・ランド買/円 売 2014年12月	買建	38,157	390,444	410,190	0.21%
		ポーランド・ズロチ買/円 売 2014年12月	買建	18,000	604,858	633,432	0.32%
シンガポール・ドル買/円 売 2014年12月	買建	7,500	658,726	681,225	0.34%		

(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。

新興国債券マザーファンド

(1) 投資状況 (平成26年11月28日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	6,117,036,058	96.37
内 アメリカ	6,117,036,058	96.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	230,667,240	3.63
純資産総額	6,347,703,298	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)	115,356,554	1.82
内 日本	115,356,554	1.82

(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26年11月28日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	2,165,430	114.58 293,368,505	109.93 281,461,928	7.500000 2030/03/31	4.43
2	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	712,000	119.63 100,704,767	122.52 103,141,250	6.050000 2040/01/11	1.62
3	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	774,000	101.26 92,664,535	103.67 94,873,013	4.750000 2044/03/08	1.49
4	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	450,000	169.18 90,012,045	159.52 84,870,223	12.750000 2028/06/24	1.34
5	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	600,000	113.78 80,715,621	115.75 82,110,735	5.550000 2045/01/21	1.29
6	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	600,000	103.85 73,670,886	105.62 74,928,262	4.000000 2023/10/02	1.18
7	FED REPUBLIC OF BRAZIL	アメリカ	国債証券	600,000	100.80 71,505,504	102.37 72,622,777	4.250000 2025/01/07	1.14
8	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	600,000	102.56 72,755,786	100.89 71,570,057	5.000000 2020/04/29	1.13
9	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	462,000	121.22 66,216,012	125.30 68,441,691	7.375000 2025/02/05	1.08
10	Philippine Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	139.26 65,860,021	143.87 68,041,365	7.750000 2031/01/14	1.07
11	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	456,000	119.05 64,184,997	124.50 67,121,535	6.875000 2036/03/17	1.06
12	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	512,000	111.42 67,452,224	109.35 66,193,666	5.625000 2017/01/15	1.04
13	Peruvian Government International Bond	アメリカ	国債証券	353,000	153.79 64,186,180	156.50 65,315,572	8.750000 2033/11/21	1.03
14	FED REPUBLIC OF BRAZIL	アメリカ	国債証券	500,000	108.80 64,320,075	108.32 64,036,323	4.875000 2021/01/22	1.01
15	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	416,000	127.88 62,898,360	129.75 63,815,824	6.750000 2034/09/27	1.01
16	Peruvian Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	132.88 62,845,156	133.50 63,134,820	7.350000 2025/07/21	0.99
17	Philippine Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	126.44 59,796,004	132.87 62,839,245	6.375000 2034/10/23	0.99

18	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	425,000	132.45 66,556,455	122.27 61,440,436	11.000000 2018/07/24	0.97
19	Indonesia Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	117.62 55,627,215	125.12 59,174,115	6.750000 2044/01/15	0.93
20	Hungary Government International Bond	アメリカ	国債証券	432,000	113.35 57,896,285	115.34 58,914,917	6.375000 2021/03/29	0.93
21	Lithuania Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	122.68 58,021,254	122.12 57,755,355	7.375000 2020/02/11	0.91
22	Colombia Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	118.45 56,017,374	120.75 57,105,090	6.125000 2041/01/18	0.90
23	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	113.36 53,612,575	115.22 54,491,261	6.250000 2022/09/26	0.86
24	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	258,000	171.62 52,352,823	178.00 54,295,945	11.875000 2030/01/15	0.86
25	South Africa Government International	アメリカ	国債証券	400,000	112.87 53,378,480	114.55 54,172,986	5.875000 2025/09/16	0.85
26	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	108.13 51,140,386	114.12 53,971,995	6.000000 2041/01/14	0.85
27	Colombia Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	111.82 52,884,279	114.00 53,912,880	5.625000 2044/02/26	0.85
28	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	109.62 51,841,490	112.56 53,231,875	5.750000 2024/03/22	0.84
29	Philippine Government International Bond	アメリカ	国債証券	278,000	158.50 52,095,684	161.87 53,204,977	9.500000 2030/02/02	0.84
30	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	112.58 53,244,880	112.37 53,144,385	6.750000 2018/04/03	0.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	96.37%
合計	96.37%

(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 2014年12月	買建	975,780	115,274,724	115,356,554	1.82%

(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。

[次へ](#)

## (参考情報) 運用実績

2014年11月28日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	12,475円
純資産総額	42百万円



## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1か月間	6.9%
3か月間	9.1%
6か月間	13.1%
1年間	15.7%
3年間	-
5年間	-
設定来	24.8%

※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 0円 設定来分配金合計額: 0円

決算期	第1期						
	14年5月						
分配金	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

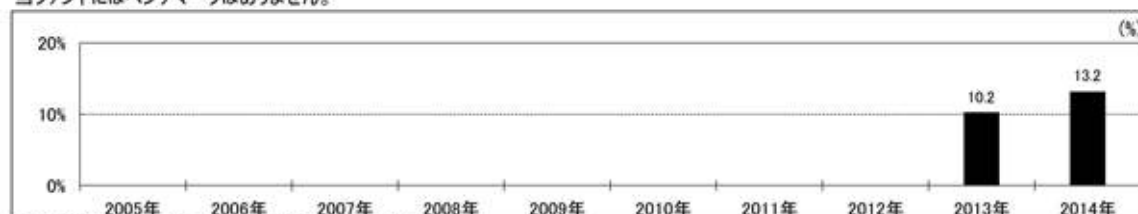
※比率は、純資産総額に対するものです。

マザーファンド(MF)別構成	比率	資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	組入上位銘柄(除く債券)	国・地域名	比率
新興国株式MF	16.7%	外国債券	267	31.5%	米ドル	39.5%	ミニTPX先物 2612月	日本	16.7%
先進国株式MF	16.7%	国内債券	220	26.7%	日本円	33.6%	SPDR S&P 500 ETF TRUST	アメリカ	8.5%
国内株式MF	16.6%	外国株式・先物	588	17.9%	ユーロ	11.8%	ISHARES MSCI EUROPE UCITS ET	アイルランド	4.6%
新興国債券MF	16.5%	国内株式・先物	1	16.7%	香港ドル	3.1%	S&P500 E-MINI FUTURE 201412	アメリカ	2.0%
先進国債券MF	16.5%	外国投資信託等	9	15.5%	韓国ウォン	2.1%	MINI MSCI EMG MKT 201412	アメリカ	1.4%
国内債券MF	16.2%	外国リート	4	0.1%	台湾ドル	1.7%	SGX CNX NIFTY ETS 201412	インド	1.1%
					英ポンド	1.4%	ISHARES MSCI PACIFIC EX JPN	アメリカ	0.9%
					南アフリカ・ランド	1.3%	ISHARES MSCI CANADA ETF	アメリカ	0.8%
					ブラジル・リアル	1.1%	ISHARES MSCI EMERGING MKT ET	アメリカ	0.5%
		コール・ローン、その他		13.0%	その他	4.5%	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	0.5%
合計	99.2%	合計	1,089	-	合計	100.0%	合計		36.9%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 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。  
・2013年は設定日(6月10日)から年末、2014年は11月28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。

## 第2 【管理及び運営】

## 3 【資産管理等の概要】

## (5) 【その他】

&lt; 訂正前 &gt;

信託の終了

&lt; 略 &gt;

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

&lt; 略 &gt;

信託約款の変更等

&lt; 略 &gt;

2. 委託会社は、前1. の事項（前1. の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

&lt; 略 &gt;

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

&lt; 略 &gt;

反対者の買取請求権

前 1. から5. までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 1. の規定にしたがい重大な信託約款の変更等を行なう場合には、書面決議において当該解約または重大な信託約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取すべき旨を請求することができます。この買取請求権の内容および買取請求の手續きに関する事項は、前 1. の2. または前 1. の2. に規定する書面に付記します。

運用報告書

委託会社は、計算期間の末日ごとに、期間中の運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。

&lt; 略 &gt;

&lt; 訂正後 &gt;

信託の終了

&lt; 略 &gt;

4. 前2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

&lt; 略 &gt;

## 信託約款の変更等

< 略 >

2. 委託会社は、前1.の事項（前1.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、前1.の併合事項にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

< 略 >

4. 前2.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上にあたる多数をもって行ないます。

< 略 >

### 反対受益者の受益権買取請求権の不適用

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権買取請求の規定の適用を受けません。

## 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を計算期間の末日ごとに作成し、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。

・委託会社のホームページ

アドレス <http://www.daiwa-am.co.jp/>

3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

< 略 >

(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26年5月9日から平成26年11月8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。

スマート・ミックス・Dガード（為替ヘッジなし）

[次へ](#)

## (1) 中間貸借対照表

	当中間計算期間末 平成26年11月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		585,292
親投資信託受益証券		40,659,781
流動資産合計		41,245,073
資産合計		41,245,073
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		8,754
未払委託者報酬		228,730
その他未払費用		1,216
流動負債合計		238,700
負債合計		238,700
純資産の部		
元本等		
元本	1	34,030,039
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）		6,976,334
（分配準備積立金）		489,973
元本等合計		41,006,373
純資産合計		41,006,373
負債純資産合計		41,245,073

[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26年5月9日 至 平成26年11月8日 金額(円)
営業収益	
受取利息	4
有価証券売買等損益	3,643,249
営業収益合計	3,643,253
営業費用	
受託者報酬	8,754
委託者報酬	228,730
その他費用	1,216
営業費用合計	238,700
営業利益	3,404,553
経常利益	3,404,553
中間純利益	3,404,553
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額	101,136
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,849,312
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,165,273
中間追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	2,165,273
剰余金減少額又は欠損金増加額	341,668
中間一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	341,668
中間剰余金又は中間欠損金( )	6,976,334

[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26年5月9日 至 平成26年11月8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26年11月8日現在
1. 1期首元本額	21,477,449円
期中追加設定元本額	15,973,919円
期中一部解約元本額	3,421,329円
2. 中間計算期間末日における受益権の総数	34,030,039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26年5月9日 至 平成26年11月8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26年11月8日現在
1. 金融商品の時価及び中間貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

	当中間計算期間末 平成26年11月8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26年11月8日現在
1口当たり純資産額	1.2050円

(1万口当たり純資産額)

(12,050円)

(参考)

当ファンドは、「国内株式マザーファンド」受益証券、「先進国株式マザーファンド」受益証券、「新興国株式マザーファンド」受益証券、「国内債券マザーファンド」受益証券、「先進国債券マザーファンド」受益証券及び「新興国債券マザーファンド」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](#)

## 「国内株式マザーファンド」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26年11月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		59,261,928
国債証券		111,073,820
派生商品評価勘定		8,183,454
未収利息		44,759
前払費用		9,862
差入委託証拠金		6,579,000
流動資産合計		185,152,823
資産合計		185,152,823
負債の部		
流動負債		
前受金		7,024,000
未払解約金		1,638,000
流動負債合計		8,662,000
負債合計		8,662,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	140,648,047
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		35,842,776
元本等合計		176,490,823
純資産合計		176,490,823
負債純資産合計		185,152,823

## 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26年5月9日 至 平成26年11月8日
1. 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>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>先物取引</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、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成26年11月8日現在
1. 1期首	平成26年5月9日

期首元本額	143,651,421円
期中追加設定元本額	87,219,217円
期中一部解約元本額	90,222,591円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
6資産（為替ヘッジなし）資金 拠出用ファンド（適格機関投資 家専用）	9,900,000円
スマート・ミックス・Dガード （為替ヘッジあり）	21,776,228円
スマート・ミックス・Dガード （為替ヘッジなし）	5,572,822円
スマート・アロケーション・D ガード	1,964,285円
りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	15,480,919円
DCダイナミック・アロケー ション・ファンド	15,621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）	2,235,371円
ダイワ6資産バランス・ファン ド（Dガード付／為替ヘッジあ り）	36,773,005円
ダイワ6資産バランス・ファン ド（Dガード付／為替ヘッジな し）	46,929,796円
計	140,648,047円
2. 期末日における受益権の総数	140,648,047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26年11月8日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

種 類	平成26年11月8日 現在		
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）
市場取引			評価損益 （円）

株価指数 先物取引				
買 建	168,351,500	-	176,601,000	8,249,500
合計	168,351,500	-	176,601,000	8,249,500

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 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26年11月8日現在
1口当たり純資産額	1.2548円
(1万口当たり純資産額)	(12,548円)

[次へ](#)

## 「先進国株式マザーファンド」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26年11月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		714,186
コール・ローン		3,520,438
投資信託受益証券		50,255,044
投資証券		36,625,025
派生商品評価勘定		645,960
未収配当金		93,016
未収利息		5
差入委託証拠金		7,000,662
流動資産合計		98,854,336
資産合計		98,854,336
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		71,392
未払解約金		366,000
流動負債合計		437,392
負債合計		437,392
純資産の部		
元本等		
元本	1	70,521,340
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		27,895,604
元本等合計		98,416,944
純資産合計		98,416,944
負債純資産合計		98,854,336

## 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26年5月9日 至 平成26年11月8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、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。</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、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。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、投資信託受益証券及び投資証券の配当落ち日において、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26年11月8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26年5月9日 86,293,595円 58,996,157円 74,768,412円</p>
<p>期末元本額の内訳 ファンド名 6 資産（為替ヘッジなし）資金 拠出用ファンド（適格機関投資家専用） スマート・ミックス・Dガード （為替ヘッジなし） りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド DCダイナミック・アロケー ション・ファンド ダイワ6資産バランス・ファン ド（Dガード付/為替ヘッジな し）</p>	<p>9,900,000円 5,027,759円 13,363,413円 13,137円 42,217,031円</p>
計	70,521,340円
2. 期末日における受益権の総数	70,521,340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26年11月8日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

#### 1. 株式関連

種 類	平成26年11月8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				
株価指数 先物取引				
買 建	11,333,410	-	11,667,084	333,674
合計	11,333,410	-	11,667,084	333,674

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 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。

#### 2. 通貨関連

種 類	平成26年11月8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	1,893,452	-	1,964,844	71,392
ユーロ	1,893,452	-	1,964,844	71,392
買 建	5,898,254	-	6,210,540	312,286
アメリカ・ドル	5,898,254	-	6,210,540	312,286

合計	7,791,706	-	8,175,384	240,894
----	-----------	---	-----------	---------

## (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26年11月8日現在
1口当たり純資産額	1.3956円
(1万口当たり純資産額)	(13,956円)

[次へ](#)

## 「新興国株式マザーファンド」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26年11月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		134,706,524
コール・ローン		111,087,559
株式		1,836,814,189
投資信託受益証券		25,448,625
投資証券		59,919,380
派生商品評価勘定		6,570,332
未収入金		18,932
未収配当金		1,015,256
未収利息		161
差入委託証拠金		141,583,092
流動資産合計		2,317,164,050
資産合計		2,317,164,050
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		11,788,472
未払金		41,910,224
未払解約金		124,000
流動負債合計		53,822,696
負債合計		53,822,696
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,854,099,012
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		409,242,342
元本等合計		2,263,341,354
純資産合計		2,263,341,354
負債純資産合計		2,317,164,050

## 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26年5月9日 至 平成26年11月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。  (2) 投資信託受益証券

	<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、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。</p> <p>(3)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。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買取相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、株式及び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26年11月8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	平成26年5月9日 80,990,025円 1,835,228,856円 62,119,869円
期末元本額の内訳 ファンド名 6 資産(為替ヘッジなし)資金 拠出用ファンド(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)	9,900,000円   1,781,559,941円

スマート・ミックス・Dガード (為替ヘッジなし)	5,541,384円
りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	10,778,589円
DCダイナミック・アロケー ション・ファンド	10,612円
ダイワ6資産バランス・ファン ド(Dガード付/為替ヘッジな し)	46,308,486円
計	1,854,099,012円
2. 期末日における受益権の総数	1,854,099,012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26年11月8日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 1. 株式関連

種 類	平成26年11月8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				
株価指数 先物取引				
買 建	346,702,128	-	340,219,302	6,482,826
合計	346,702,128	-	340,219,302	6,482,826

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として期末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、期末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等及び時価の邦貨換算は期末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。

4. 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。

## 2. 通貨関連

	平成26年11月8日 現在

種 類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買 建	110,324,114	-	111,588,800	1,264,686
アメリカ・ドル	110,324,114	-	111,588,800	1,264,686
合計	110,324,114	-	111,588,800	1,264,686

## (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26年11月8日現在
1口当たり純資産額	1.2207円
(1万口当たり純資産額)	(12,207円)

[次へ](#)

## 「国内債券マザーファンド」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26年11月8日現在
	金額（円）
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	41,096,567
国債証券	790,805,230
未収利息	1,595,116
前払費用	338,311
流動資産合計	833,835,224
資産合計	833,835,224
負債の部	
流動負債	
未払金	30,330,850
未払解約金	581,000
流動負債合計	30,911,850
負債合計	30,911,850
純資産の部	
元本等	
元本	1 773,269,134
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	29,654,240
元本等合計	802,923,374
純資産合計	802,923,374
負債純資産合計	833,835,224

## 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26年5月9日 至 平成26年11月8日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券  個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成26年11月8日現在
1. 1 期首	平成26年5月9日
期首元本額	510,298,968円
期中追加設定元本額	495,276,718円
期中一部解約元本額	232,306,552円
期末元本額の内訳 ファンド名	

6 資産(為替ヘッジなし)資金 拠出用ファンド(適格機関投資 家専用)	9,900,000円
スマート・ミックス・Dガード (為替ヘッジあり)	24,598,328円
スマート・ミックス・Dガード (為替ヘッジなし)	6,161,029円
スマート・アロケーション・D ガード	16,029,586円
りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	605,185,751円
DCダイナミック・アロケー ション・ファンド	576,632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)	17,082,033円
ダイワ6資産バランス・ファン ド(Dガード付/為替ヘッジあ り)	42,074,856円
ダイワ6資産バランス・ファン ド(Dガード付/為替ヘッジな し)	51,660,919円
計	773,269,134円
2. 期末日における受益権の総数	773,269,134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26年11月8日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成26年11月8日現在
該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	平成26年11月8日現在
1口当たり純資産額	1.0383円
(1万口当たり純資産額)	(10,383円)

[次へ](#)



## 「先進国債券マザーファンド」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26年11月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		736,572
コール・ローン		9,344,518
国債証券		181,230,672
派生商品評価勘定		60,606
未収入金		8,212
未収利息		1,235,669
前払費用		251,643
流動資産合計		192,867,892
資産合計		192,867,892
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		2,278
未払解約金		2,691,000
流動負債合計		2,693,278
負債合計		2,693,278
純資産の部		
元本等		
元本	1	157,524,503
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		32,650,111
元本等合計		190,174,614
純資産合計		190,174,614
負債純資産合計		192,867,892

## 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26年5月9日 至 平成26年11月8日
1. 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）、又は価格情報会社の提供する価額等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. 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</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
----------------------------	---

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成26年11月8日現在
1. 1 期首	平成26年5月9日
期首元本額	103,906,299円
期中追加設定元本額	61,935,077円
期中一部解約元本額	8,316,873円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
6 資産（為替ヘッジなし）資金	14,850,000円
抛出用ファンド（適格機関投資	
家専用）	
スマート・ミックス・Dガード	5,568,485円
（為替ヘッジなし）	
スマート・アロケーション・D	43,601,839円
ガード	
ダイワ・ダブルバランス・ファ	47,069,530円
ンド（Dガード付／部分為替	
ヘッジあり）	
ダイワ6資産バランス・ファン	46,434,649円
ド（Dガード付／為替ヘッジな	
し）	
計	157,524,503円
2. 期末日における受益権の総数	157,524,503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26年11月8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 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。</p>

## （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26年11月8日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	412,880	-	411,002	1,878
ユーロ	412,880	-	411,002	1,878
買 建	6,956,811	-	7,013,261	56,450
アメリカ・ドル	162,509	-	164,366	1,857
イギリス・ポンド	527,092	-	531,621	4,529
オーストラリア・ドル	378,283	-	378,881	598
カナダ・ドル	855,178	-	862,766	7,588
シンガポール・ドル	658,726	-	666,375	7,649
スイス・フラン	554,187	-	555,822	1,635
スウェーデン・クローナ	401,606	-	404,520	2,914
デンマーク・クローネ	146,285	-	148,446	2,161
ノルウェー・クローネ	240,170	-	240,580	410
ポーランド・ズロチ	604,858	-	606,431	1,573
メキシコ・ペソ	608,663	-	616,626	7,963
ユーロ	1,428,810	-	1,448,387	19,577
南アフリカ・ランド	390,444	-	388,440	2,004
合計	7,369,691	-	7,424,263	58,328

## (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26年11月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2073円 (12,073円)

[次へ](#)

## 「新興国債券マザーファンド」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26年11月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		79,971,133
コール・ローン		4,289,317
国債証券		5,780,804,359
派生商品評価勘定		27,878
未収利息		72,600,806
前払費用		8,668,650
流動資産合計		5,946,362,143
資産合計		5,946,362,143
負債の部		
流動負債		
未払解約金		40,000
流動負債合計		40,000
負債合計		40,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	4,937,765,738
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,008,556,405
元本等合計		5,946,322,143
純資産合計		5,946,322,143
負債純資産合計		5,946,362,143

## 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26年5月9日 至 平成26年11月8日
1. 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）、又は価格情報会社の提供する価額等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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準

外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成26年11月8日現在
1. 1 期首	平成26年5月9日
期首元本額	2,324,796,099円
期中追加設定元本額	2,821,531,733円
期中一部解約元本額	208,562,094円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
6 資産(為替ヘッジなし)資金 拠出用ファンド(適格機関投資 家専用)	29,700,000円
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)	4,840,176,865円
スマート・ミックス・Dガード (為替ヘッジなし)	5,619,655円
りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	15,273,559円
DCダイナミック・アロケー ション・ファンド	14,849円
ダイワ6資産バランス・ファン ド(Dガード付/為替ヘッジな し)	46,980,810円
計	4,937,765,738円
2. 期末日における受益権の総数	4,937,765,738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26年11月8日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と 時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。  (3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいこ とから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

種 類	平成26年11月8日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売 建	37,000,000	-	36,998,198	1,802
アメリカ・ドル	37,000,000	-	36,998,198	1,802
買 建	2,274,724	-	2,300,800	26,076
アメリカ・ドル	2,274,724	-	2,300,800	26,076
合計	39,274,724	-	39,298,998	27,878

## (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26年11月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2043円 (12,043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>

## 【純資産額計算書】

平成26年11月28日

資産総額	42,849,426円
負債総額	30,585円
純資産総額（ - ）	42,818,841円
発行済数量	34,324,852口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2475円

(参考) 国内株式マザーファンド

## 純資産額計算書

平成26年11月28日

資産総額	189,649,829円
負債総額	11,168,000円
純資産総額（ - ）	178,481,829円
発行済数量	138,050,390口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2929円

(参考) 先進国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

平成26年11月28日

資産総額	101,732,444円
負債総額	92,473円
純資産総額（ - ）	101,639,971円
発行済数量	69,016,589口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.4727円

(参考) 新興国株式マザーファンド

## 純資産額計算書

平成26年11月28日

資産総額	2,638,723,827円
負債総額	106,772,717円



純資産総額（ - ）	2,531,951,110円
発行済数量	1,972,514,427口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2836円

## (参考) 国内債券マザーファンド

## 純資産額計算書

平成26年11月28日

資産総額	824,045,364円
負債総額	1,005,290円
純資産総額（ - ）	823,040,074円
発行済数量	788,069,852口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0444円

## (参考) 先進国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

平成26年11月28日

資産総額	199,737,540円
負債総額	241円
純資産総額（ - ）	199,737,299円
発行済数量	158,747,957口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2582円

## (参考) 新興国債券マザーファンド

## 純資産額計算書

平成26年11月28日

資産総額	6,374,373,316円
負債総額	26,670,018円
純資産総額（ - ）	6,347,703,298円
発行済数量	5,099,815,120口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2447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26年11月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

#### ホ．ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク会議

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

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成26年11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）
単体型株式投資信託	20	188,510
追加型株式投資信託	535	11,023,383
株式投資信託 合計	555	11,211,893
単体型公社債投資信託	1	9,199
追加型公社債投資信託	17	3,303,209
公社債投資信託 合計	18	3,312,408
総合計	573	14,524,301

## 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55期事業年度（平成25年4月1日から平成26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56期事業年度に係る中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

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

## (1) 【貸借対照表】

（単位:千円）

	前事業年度 （平成25年3月31日現在）	当事業年度 （平成26年3月31日現在）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	14,380,327	15,186,222
有価証券	9,427,636	15,003,765
前払金	207	453
前払費用	142,919	157,453
未収入金	521,825	-
未収委託者報酬	7,183,011	8,265,950
未収収益	106,914	103,432
貯蔵品	9,551	14,492
繰延税金資産	491,727	674,141
その他	8,445	597
流動資産計	32,272,567	39,406,511
固定資産		
有形固定資産	1 254,258	1 252,417
建物（純額）	26,257	23,555

器具備品(純額)		222,274		224,362
リース資産(純額)		5,726		4,499
無形固定資産		3,194,512		2,991,462
ソフトウェア		3,132,238		2,910,918
ソフトウェア仮勘定		50,423		68,693
電話加入権		11,850		11,850
投資その他の資産		15,113,434		15,077,046
投資有価証券		8,342,934		8,338,733
関係会社株式		5,141,069		5,141,069
出資金		136,315		129,405
従業員に対する長期貸付金		92,527		68,396
差入保証金		1,000,820		997,594
長期前払費用		7,376		6,484
投資不動産(純額)	1	402,340	1	398,402
貸倒引当金		9,950		3,040
固定資産計		18,562,205		18,320,926
資産合計		50,834,773		57,727,438

(単位:千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
リース債務	1,227	1,227
預り金	56,491	53,677
未払金	6,795,899	8,998,456
未払収益分配金	10,333	7,931
未払償還金	113,002	77,698
未払手数料	3,764,501	4,277,412
その他未払金	2 2,908,061	2 4,635,414
未払費用	3,383,551	3,463,796
未払法人税等	588,040	1,530,565
未払消費税等	189,139	530,831
賞与引当金	841,300	955,600
流動負債計	11,855,648	15,534,154
<b>固定負債</b>		
リース債務	4,494	3,272
退職給付引当金	1,935,442	1,959,451
役員退職慰労引当金	67,410	80,280
繰延税金負債	1,740,407	1,789,543

固定負債計	3,747,753	3,832,547
負債合計	15,603,402	19,366,702
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174,272	15,174,272
資本剰余金		
資本準備金	11,495,727	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727	11,495,727
利益剰余金		
利益準備金	374,297	374,297
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	7,722,723	10,821,849
利益剰余金合計	8,097,020	11,196,146
株主資本合計	34,767,020	37,866,146
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	464,350	494,589
評価・換算差額等合計	464,350	494,589
純資産合計	35,231,371	38,360,735
負債・純資産合計	50,834,773	57,727,438

## (2) 【損益計算書】

(単位:千円)

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	73,498,726	84,771,977
その他営業収益	526,465	788,473
営業収益計	74,025,191	85,560,451
営業費用		
支払手数料	41,213,272	47,520,063
広告宣伝費	604,864	668,841
公告費	949	533
受益証券発行費	-	25
調査費	8,116,701	8,246,807
調査費	824,915	741,792
委託調査費	7,291,786	7,505,015
委託計算費	807,090	735,588
営業雑経費	1,280,599	1,322,711
通信費	206,564	249,081
印刷費	404,023	477,092
協会費	53,643	54,190

諸会費	11,281	11,711
その他営業雑経費	605,086	530,634
営業費用計	52,023,478	58,494,570
一般管理費		
給料	5,264,128	5,708,541
役員報酬	249,180	243,000
給料・手当	3,782,533	3,785,717
賞与	391,114	724,223
賞与引当金繰入額	841,300	955,600
福利厚生費	809,254	793,740
交際費	55,806	37,951
寄付金	636	-
旅費交通費	196,147	191,623
租税公課	206,178	222,767
不動産賃借料	887,968	1,182,703
退職給付費用	469,713	373,920
役員退職慰労引当金繰入額	38,970	33,750
固定資産減価償却費	1,181,438	963,183
諸経費	1,094,627	1,354,169
一般管理費計	10,204,869	10,862,351
営業利益	11,796,843	16,203,530

(単位:千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 至	平成24年4月1日 平成25年3月31日)	(自 至	平成25年4月1日 平成26年3月31日)
営業外収益				
受取配当金	1	257,704	1	144,660
有価証券利息		11,102		13,966
受取利息		10,598		9,117
時効成立分配金・償還金		21,305		44,877
投資有価証券売却益		279,443		64,122
有価証券償還益		101,052		63,228
その他		44,912		34,445
営業外収益計		726,118		374,418
営業外費用				
時効成立後支払分配金・償還金		19,392		16,985
投資有価証券売却損		36,469		3,171
有価証券償還損		33,338		18,848
投資不動産管理費用		16,271		16,864
貯蔵品廃棄損		9,990		9,503

その他		13,120		9,343
営業外費用計		128,584		74,716
経常利益		12,394,377		16,503,232
特別利益				
投資有価証券売却益		39,827		-
固定資産売却益		31		-
その他		16,466		-
特別利益計		56,325		-
特別損失				
固定資産除却損	2	129,816	2	888
本社移転関連費用		1,099,913		-
その他		14,428		-
特別損失計		1,244,158		888
税引前当期純利益		11,206,544		16,502,343
法人税、住民税及び事業税		4,286,691		6,525,874
法人税等調整額		109,902		150,022
法人税等合計		4,176,789		6,375,851
当期純利益		7,029,755		10,126,492

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)



	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,715,116	8,089,414	34,759,414
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,022,149	△7,022,149	△7,022,149
当期純利益	-	-	-	7,029,755	7,029,755	7,029,755
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	7,606	7,606	7,606
当期末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,722,723	8,097,020	34,767,020

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	33,879	53,783	87,663	34,847,077
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△7,022,149
当期純利益	-	-	-	7,029,755
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	430,470	△53,783	376,686	376,686
当期変動額合計	430,470	△53,783	376,686	384,293
当期末残高	464,350	-	464,350	35,231,371

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,722,723	8,097,020	34,767,020
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△7,027,366	△7,027,366	△7,027,366
当期純利益	-	-	-	10,126,492	10,126,492	10,126,492
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	3,099,125	3,099,125	3,099,125
当期末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	10,821,849	11,196,146	37,866,146

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他有価証券評価差額金	繰延ヘッジ損益	評価・換算差額等合計	
当期首残高	464,350	-	464,350	35,231,371
当期変動額				
剰余金の配当	-	-	-	△7,027,366
当期純利益	-	-	-	10,126,492
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	30,238	-	30,238	30,238
当期変動額合計	30,238	-	30,238	3,129,364
当期末残高	494,589	-	494,589	38,360,735

## 注記事項

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産及び投資不動産(リース資産を除く)

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 8～47年

器具備品 4～20年

（会計上の見積もりの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、当事業年度より有形固定資産（投資不動産を含む）の減価償却方法を定率法から定額法に変更いたしました。

この変更は、本社移転を契機に当社の有形固定資産の使用実態を見直した結果、当社において使用する有形固定資産は安定的に使用されており、その投資効果は、耐用年数の期間中に平均的・安定的に発現するものであるため、定額法が当社の企業活動をより適切に反映した減価償却方法であると判断したためであります。

この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微です。

（２）無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

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

（３）長期前払費用

定額法によっております。

（４）リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

３．引当金の計上基準

（１）貸倒引当金

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

（２）賞与引当金

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

（３）退職給付引当金

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

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

（４）役員退職慰労引当金

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

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処理によっております。

（２）連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## （表示方法の変更）

## （損益計算書）

前事業年度において、「営業外費用」の「その他」に含めていた「貯蔵品廃棄損」は重要性が増したため当事業年度より区分掲記することとしました。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の損益計算書において、「営業外費用」の「その他」に表示していた23,111千円は、「貯蔵品廃棄損」9,990千円、「その他」13,120千円として組替えております。

## （貸借対照表関係）

## 1 有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
建物	15,528千円	18,230千円
器具備品	250,072千円	249,761千円
リース資産	409千円	1,636千円
投資建物	724,130千円	729,348千円
投資器具備品	23,691千円	24,180千円

## 2 関係会社項目

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

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
未払金	2,883,398千円	4,508,988千円

## 3 保証債務

前事業年度（平成25年3月31日現在）

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

当事業年度（平成26年3月31日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719,900千円に対して保証を行っております。

## （損益計算書関係）

## 1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	当事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)
受取配当金	185,280千円	-

## 2 固定資産除却損の内容は次のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	当事業年度 (自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)
建物	546千円	-
器具備品	128,892千円	888千円
無形固定資産(その他)	377千円	-
計	129,816千円	888千円

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26年 3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年6月24日 定時株主総会	普通株式	7,027	2,694	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

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

平成26年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

( ) 為替変動リスクの管理

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

( ) 価格変動リスクの管理

当社は、財務リスク管理規程に従い、個別の案件ごとに価格変動リスク管理の検討を行っており、定期的に時価や発行体の財務状況等を把握し財務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財務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25年3月31日現在)

(単位:千円)

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

(\*) 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26年3月31日現在)

(単位:千円)

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	15,186,222	15,186,222	-
(2) 未収委託者報酬	8,265,950	8,265,950	-
(3) 未収入金	-	-	-
(4) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	22,283,329	22,283,329	-
資産計	45,735,503	45,735,503	-
(1) 未払手数料	4,277,412	4,277,412	-
(2) その他未払金	4,635,414	4,635,414	-
(3) 未払費用(*)	2,678,610	2,678,610	-
負債計	11,591,437	11,591,437	-

(\*) 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。

## &lt;注1&gt;金融商品の時価の算定方法

## 資 産

- (1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、並びに(3) 未収入金

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

- (4) 有価証券及び投資有価証券

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

## 負 債

- (1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

## &lt;注2&gt;時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,059,169	1,059,169
(2) 子会社株式及び関連会社株式 子会社株式	5,141,069	5,141,069
(3) 差入保証金	1,000,820	997,594

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。

## &lt;注3&gt;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25年3月31日現在）

(単位：千円)

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

当事業年度（平成26年3月31日現在）

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	15,186,222	-	-	-
未収委託者報酬	8,265,950	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				



その他有価証券のうち満期があるもの	-	1,498,464	3,978,251	97,038
合計	23,452,173	1,498,464	3,978,251	97,038

## (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25年3月31日現在)

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

当事業年度(平成26年3月31日現在)

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

## 2. その他有価証券

前事業年度(平成25年3月31日現在)

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

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

当事業年度(平成26年3月31日現在)

	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	113,247	55,101	58,145
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	5,625,179	4,873,552	751,626
小計	5,738,426	4,928,653	809,772

貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託の受益証券	16,544,903	16,586,202	41,299
小計	16,544,903	16,586,202	41,299
合計	22,283,329	21,514,856	768,472

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

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

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

種類	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他			
証券投資信託の受益証券	24,501,921	64,122	3,171
合計	24,501,921	64,122	3,171

### 4. 減損処理を行った有価証券

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

当事業年度において、該当事項はありません。

### (退職給付関係)

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、一時払いの退職金制度、及び確定拠出年金制度を併用しております。

#### 2. 退職給付債務に関する事項

退職給付債務	1,935,442千円
退職給付引当金	1,935,442千円

#### 3. 退職給付費用に関する事項

勤務費用	301,777千円
その他	167,935千円
退職給付費用	469,713千円

(注) 「その他」は、確定拠出年金への掛金支払額であります。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

### 2. 確定給付制度

#### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

期首における退職給付債務	1,935,442千円
勤務費用	201,327千円
退職給付の支払額	177,317千円
期末における退職給付債務	1,959,451千円

#### (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

積立型制度の退職給付債務	-
年金資産	-
非積立型制度の退職給付債務	1,959,451千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,959,451千円
退職給付引当金	1,959,451千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,959,451千円

#### (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	201,327千円
確定給付制度に係る退職給付費用	201,327千円

### 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、172,593千円でありました。

#### (表示方法の変更)

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を当事業年度より適用し（ただし、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めを除く。）、（退職給付関係）注記の表示方法を変更しております。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っており、（退職給付関係）の注記の組替えは行っておりません。

#### (税効果会計関係)

### 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別内訳

（単位：千円）

	前事業年度 (平成25年3月31日現在)	当事業年度 (平成26年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	837,121	833,243
退職給付引当金	693,199	698,348
未払事業税	154,219	335,386
賞与引当金	280,855	287,721
連結法人間取引(譲渡損)	264,269	141,925
投資有価証券評価損	128,953	128,953
繰延資産	157,330	121,437
出資金評価損	114,425	116,888
未払社会保険料	43,411	38,787
器具備品	33,316	33,316
役員退職慰労引当金	24,920	28,611
その他	29,627	24,709
繰延税金資産小計	2,761,651	2,789,330
評価性引当額	1,323,069	1,200,725
繰延税金資産合計	1,438,582	1,588,604
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,428,233	2,428,233
その他有価証券評価差額金	257,138	273,883
その他	1,888	1,888
繰延税金負債合計	2,687,261	2,704,006
繰延税金負債の純額	1,248,679	1,115,401

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

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

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26年法律第10号)が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が課されないこととなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用した法定実効税率は、平成26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前事業年度の38.01%から35.64%に変更されております。

この変更による影響は軽微であります。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

### (1) 営業収益

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

### (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

該当事項はありません。

### [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24年4月1日 至 平成25年3月31日）

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

#### 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,719,900	-	-

## 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24年4月1日 至 平成25年3月31日)

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

## 当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料	25,994,992	未払手数料	3,216,077
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入	678,054	未払費用	393,881

同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料	978,984	長期差入保証金	971,157
-------------	------------	--------	-----	--------	---	---------	---------	---------	---------	---------

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 証券投資信託の代行手数料については、証券投資信託の信託約款に定める受益者が負担する信託報酬のうち、当社が受け取る委託者報酬から代理事務に係る手数料として代行手数料を支払います。手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定しております。
- (2) ソフトウェアの購入については、市場の実勢価格を勘案して、その都度交渉の上、購入価格を決定しております。
- (3) 差入保証金および賃借料については、近隣相場等を勘案し、交渉の上、決定しております。

2. 親会社に関する注記

(株)大和証券グループ本社(東京証券取引所、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24年4月1日 至 平成25年3月31日)		当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)	
1株当たり純資産額	13,506.24円	1株当たり純資産額	14,705.91円
1株当たり当期純利益	2,694.91円	1株当たり当期純利益	3,882.07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24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
当期純利益(千円)	7,029,755	10,126,492
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:千円)

当中間会計期間  
(平成26年9月30日)

資産の部

流動資産		
現金・預金		20,257,586
有価証券		5,207,068
未収委託者報酬		9,365,956
貯蔵品		15,509
繰延税金資産		495,241
その他		296,277
流動資産計		35,637,638
固定資産		
有形固定資産	1	283,555
無形固定資産		
ソフトウェア		2,634,889
その他		90,103
無形固定資産合計		2,724,992
投資その他の資産		
投資有価証券		6,866,175
関係会社株式		5,129,895
その他	1	1,589,226
投資その他の資産合計		13,585,297
固定資産計		16,593,845
資産合計		52,231,483

(単位:千円)

当中間会計期間  
(平成26年9月30日)

## 負債の部

流動負債		
リース債務		1,227
未払金		6,923,613
未払費用		3,196,727
未払法人税等		1,144,931
賞与引当金		796,000
その他	3	848,229
流動負債計		12,910,729
固定負債		
リース債務		2,658



退職給付引当金	1,996,246
役員退職慰労引当金	92,730
繰延税金負債	1,845,611
固定負債計	3,937,247
負債合計	16,847,976
純資産の部	
株主資本	
資本金	15,174,272
資本剰余金	
資本準備金	11,495,727
資本剰余金合計	11,495,727
利益剰余金	
利益準備金	374,297
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	7,668,191
利益剰余金合計	8,042,489
株主資本合計	34,712,489
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	671,018
評価・換算差額等合計	671,018
純資産合計	35,383,507
負債・純資産合計	52,231,483

## (2) 中間損益計算書

(単位:千円)

	当中間会計期間	
	(自 平成26年4月1日	至 平成26年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		44,022,288
その他営業収益		472,415
営業収益計		44,494,704
営業費用		
支払手数料		24,490,036
その他営業費用		5,489,326
営業費用計		29,979,363
一般管理費	1	5,507,021
営業利益		9,008,319
営業外収益	2	1,299,244

営業外費用	1, 3	34,669
経常利益		10,272,894
特別利益		-
特別損失	4	12,947
税引前中間純利益		10,259,946
法人税、住民税及び事業税		3,150,039
法人税等調整額		137,269
中間純利益		6,972,636

## (3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174,272	11,495,727	374,297	10,821,849	11,196,146	37,866,146
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△ 10,126,294	△ 10,126,294	△ 10,126,294
中間純利益	-	-	-	6,972,636	6,972,636	6,972,636
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	-	-	-	△ 3,153,657	△ 3,153,657	△ 3,153,657
当中間期末残高	15,174,272	11,495,727	374,297	7,668,191	8,042,489	34,712,489

	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	494,589	494,589	38,360,735
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	△ 10,126,294
中間純利益	-	-	6,972,636
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	176,428	176,428	176,428
当中間期変動額合計	176,428	176,428	△ 2,977,228
当中間期末残高	671,018	671,018	35,383,507

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社及び関連会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

## 時価のあるもの

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

## 時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産及び投資不動産（リース資産を除く）

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5～47年
器具備品	3～20年

## (2) 無形固定資産（リース資産を除く）

定額法によっております。

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

## (3) 長期前払費用

定額法によっております。

## (4) リース資産

リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

## 3．引当金の計上基準

## (1) 貸倒引当金

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

## (2) 賞与引当金

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

## (3) 退職給付引当金

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

## (4) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、当社の役員退職慰労金規程に基づく当中間会計期間未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26年9月30日現在)
有形固定資産	279,523千円
投資その他の資産	756,255千円

##### 2 保証債務

当中間会計期間(平成26年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,805,580千円に対して保証を行っております。

##### 3 消費税等の取扱い

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

#### (中間損益計算書関係)

##### 1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
有形固定資産	16,065千円
無形固定資産	490,092千円
投資その他の資産	2,726千円

##### 2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
受取配当金	1,177,840千円
投資有価証券売却益	73,930千円
時効成立分配金・償還金	14,749千円

## 3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
時効成立後支払分配金・償還金	12,351千円
貯蔵品廃棄損	7,356千円
投資不動産管理費用	6,818千円

## 4 特別損失の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
関係会社株式評価損	11,174千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数(千株)	当中間会計期間 増加株式数(千株)	当中間会計期間 減少株式数(千株)	当中間会計期間末 株式数(千株)
発行済株式				
普通株式	2,608	-	-	2,608
合計	2,608	-	-	2,608

## 2. 配当に関する事項

## 配当金支払額

(決議)	株式の種類	配当金の総額 (百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成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

(金融商品関係)

当中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26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：千円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	20,257,586	20,257,586	-
(2) 未収委託者報酬	9,365,956	9,365,956	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	11,047,833	11,047,833	-
資産計	40,671,376	40,671,376	-
(1) 未払金	6,923,613	6,923,613	-
(2) 未払費用(*)	2,760,751	2,760,751	-
負債計	9,684,365	9,684,365	-

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

#### <注1>金融商品の時価の算定方法

##### 資 産

##### (1) 現金・預金及び(2) 未収委託者報酬

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

##### (3) 有価証券及び投資有価証券

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

##### 負 債

##### (1) 未払金及び(2) 未払費用

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

#### <注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額
非上場株式	1,025,409
子会社株式	5,129,895
差入保証金	997,068

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

(有価証券関係)

当中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26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 5,129,895千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

当中間会計期間において、子会社株式について11,174千円減損処理を行っております。

## 2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	105,492	55,101	50,390
(2) その他			
証券投資信託の受益証券	5,646,254	4,624,425	1,021,828
小計	5,751,746	4,679,527	1,072,219
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			
証券投資信託の受益証券	5,296,087	5,325,705	29,618
小計	5,296,087	5,325,705	29,618
合計	11,047,833	10,005,232	1,042,601

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額 1,025,409千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26年9月30日 )	
1株当たり純資産額	13,564.56円
1株当たり中間純利益金額	2,673.01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26年4月1日 至 平成26年9月30日 )	
中間純利益(千円)	6,972,636
普通株式に係る中間純利益(千円)	6,972,636
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

## ( 重要な後発事象 )

該当事項はありません。





#### 4 【利害関係人との取引制限】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 4 利害関係人との取引制限および5 その他」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

運用財産相互間において取引を行なうことを内容とした運用を行なうこと（投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

通常の実行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26年1月17日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているスマート・ミックス・Dガード（為替ヘッジなし）の平成25年6月10日から平成25年12月9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、スマート・ミックス・Dガード（為替ヘッジなし）の平成25年12月9日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成25年6月10日から平成25年12月9日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

---

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

（注2） 中間財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成26年 5月26日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成25年4月1日から平成26年3月31日までの第55期事業年度の財務諸表、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26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26年11月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第56期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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26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26年4月1日から平成26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。