

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 平成26年8月1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】 りそな ダイナミック・アロケーション・ファンド
（愛称：攻守のチカラ）

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 (1) 当初自己設定（平成25年10月21日）
100万円とします。
(2) 継続申込期間（平成25年10月21日から平成27年1
月30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25年9月27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、有価証券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。 ）

第一部 【証券情報】

(4) 【発行（売出）価格】

< 訂正前 >

< 略 >

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

< 略 >

(5) 【申込手数料】

< 訂正前 >

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.1%（税抜2.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

消費税率に応じて変更となることがあります（消費税率が8%になった場合は、2.16%となります。）。

< 略 >

< 訂正後 >

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.16%（税抜2.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

< 略 >

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

< 訂正前 >

< 略 >

< ファンドの特色 >

< 略 >

2 < 略 >

< 略 >

当初設定日後、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、ファンドの特色1.および2.の運用が行なわれないことがあります。

[マザーファンドの概要]

< 略 >

新興国債券 マザーファンド	新興国の国家機関が発行する債券	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。
国内株式 マザーファンド	国内株式、国内株式を対象とした株価指数先物取引および国内の債券	国内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。
先進国株式 マザーファンド	先進国株式、先進国株式を対象とした株価指数先物取引、先進国株式の指数を対象指数としたETFおよび国内の債券	日本を除く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。
新興国株式 マザーファンド	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	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。
国内REIT マザーファンド	国内のリート、国内のリートを対象としたリート指数先物取引および国内の債券	国内のリート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。
先進国REIT マザーファンド	先進国のリート、先進国のリート指数を対象指数としたETF、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引および国内の債券	日本を除く先進国のリート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。
ダイワ・マネー マザーファンド	本邦通貨表示の公社債	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。

分配方針

毎年5月8日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

(注)第1計算期間は、平成26年5月8日(休業日の場合翌営業日)までとします。

〈分配方針〉

- ① 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。
- ② 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。

<訂正後>

<略>

<ファンドの特色>

<略>

2 <略>

<略>

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、ファンドの特色1.および2.の運用が行なわれないことがあります。

[マザーファンドの概要]

<略>

新興国債券 マザーファンド	新興国の国家機関が発行する債券	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。 ^(※1)
国内株式 マザーファンド	国内株式、国内株式を対象とした株価指数先物取引 ^(※2)	国内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。
先進国株式 マザーファンド	先進国株式、先進国株式を対象とした株価指数先物取引 ^(※2) および先進国株式の指数を対象指数としたETF	日本を除く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。
新興国株式 マザーファンド	新興国株式、新興国株式を対象とした株価指数先物取引 ^(※2) および新興国株式の指数を対象指数としたETF	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。
国内REIT マザーファンド	国内のリート、国内のリートを対象としたリート指数先物取引 ^(※2)	国内のリート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。
先進国REIT マザーファンド	先進国のリート、先進国のリート指数を対象指数としたETF、先進国のリートを対象としたリート指数先物取引 ^(※2)	日本を除く先進国のリート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。
ダイワ・マネー・ マザーファンド	本邦通貨表示の公社債	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。

(※1)流動性を確保するため、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。

(※2)先物取引を利用する場合、国内の債券に投資することがあります。

分配方針

毎年5月8日(休業日の場合翌営業日)に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

- ① 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。
- ② 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。

(2) 【ファンドの沿革】

< 訂正前 >

平成25年10月21日 信託契約締結、当初自己設定、運用開始（予定）

< 訂正後 >

平成25年10月21日 信託契約締結、当初自己設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

< 訂正前 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成25年8月末日現在） >

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

< 委託会社の概況（平成26年5月末日現在） >

< 略 >

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

< 略 >

上記の運用体制は平成25年8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 >

< 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。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

< 訂正前 >

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.1%（税抜2.0%）となっています。
具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

消費税率に応じて変更となることがあります（消費税率が8%になった場合は、2.16%となります。）。

< 略 >

< 訂正後 >

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.16%（税抜2.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

< 略 >

(3) 【信託報酬等】

< 訂正前 >

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.26%（税抜1.2%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

消費税率に応じて変更となることがあります（消費税率が8%になった場合は、年率1.296%となります。）。

< 略 >

< 訂正後 >

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.296%（税抜1.2%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎計算期間の最初の6か月終了日（6か月終了日が休業日の場合には、翌営業日とします。）および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

< 略 >

(5) 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、平成25年12月31日までは特例措置として、軽減税率が適用されます。また、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課されます。

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

期間	税率
平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%および地方税3%）

平成26年1月1日から	20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）
-------------	---------------------------------------

ロ．解約金および償還金に対する課税

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

期間ごとの税率は、上記イ．の表と同じです。

< 略 >

法人の投資者に対する課税

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

期間ごとの税率は、以下のとおりとなります。

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

なお、税額控除制度が適用されます。益金不算入制度の適用はありません。

< 略 >

（ ）上記は、平成25年8月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

< 略 >

< 訂正後 >

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）

の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、平成49年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%)となります。

< 略 >

法人の投資者に対する課税

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

なお、税額控除制度が適用されます。益金不算入制度の適用はありません。

< 略 >

() 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。

< 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5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	905,804,273	99.27
内 日本	905,804,273	99.27
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,652,683	0.73
純資産総額	912,456,956	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5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	国内債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	409,891,558	1.0215 418,732,371	1.0233 419,442,031	45.97
2	先進国債券(為替ヘッジあり)マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	192,952,999	1.0351 199,727,829	1.0443 201,500,816	22.08
3	国内REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	51,123,970	1.0200 52,149,984	1.0709 54,748,659	6.00
4	国内株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	46,594,630	1.0577 49,286,865	1.0962 51,077,033	5.60
5	新興国債券マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	46,854,814	1.0576 49,555,283	1.0764 50,434,521	5.53
6	先進国株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	38,416,966	1.2103 46,496,807	1.2301 47,256,709	5.18
7	先進国REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	38,812,974	1.1890 46,151,750	1.1954 46,397,029	5.08
8	新興国株式マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	30,864,149	1.0990 33,921,469	1.1323 34,947,475	3.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.27%
合計	99.27%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
平成25年10月末日	1,002,075	-	1.0021	-
11月末日	1,009,718	-	1.0097	-
12月末日	1,019,784	-	1.0198	-
平成26年1月末日	483,720,214	-	1.0006	-
2月末日	685,314,304	-	1.0080	-
3月末日	875,132,717	-	1.0064	-
4月末日	945,199,712	-	1.0093	-
第1計算期間末 (平成26年5月8日)	954,560,779	954,560,779	1.0114	1.0114
5月末日	912,456,956	-	1.0218	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第1計算期間	0.0000

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	1.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第1計算期間	964,865,153	22,041,973

(注) 当初設定数量は1,000,000口です。

(参考) マザーファンド

国内債券マザーファンド

(1) 投資状況 (平成26年5月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	522,901,560	97.57
内 日本	522,901,560	97.57
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	12,999,175	2.43
純資産総額	535,900,735	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5月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	101 5年国債	日本	国債証券	9,000,000	100.79 9,071,370	100.77 9,069,750	0.400000 2016/12/20	1.69
2	287 10年国債	日本	国債証券	8,000,000	105.57 8,446,000	105.46 8,437,360	1.900000 2017/06/20	1.57
3	117 5年国債	日本	国債証券	8,000,000	100.08 8,006,840	100.14 8,011,360	0.200000 2019/03/20	1.49
4	336 2年国債	日本	国債証券	8,000,000	100.03 8,002,800	100.03 8,002,560	0.100000 2016/01/15	1.49
5	297 10年国債	日本	国債証券	7,000,000	105.59 7,391,930	105.59 7,391,860	1.400000 2018/12/20	1.38
6	282 10年国債	日本	国債証券	7,000,000	103.80 7,266,140	103.70 7,259,350	1.700000 2016/09/20	1.35
7	114 5年国債	日本	国債証券	7,000,000	100.60 7,042,420	100.64 7,044,800	0.300000 2018/09/20	1.31
8	332 10年国債	日本	国債証券	7,000,000	100.18 7,012,740	100.45 7,031,710	0.600000 2023/12/20	1.31
9	106 5年国債	日本	国債証券	7,000,000	100.26 7,018,270	100.29 7,020,650	0.200000 2017/09/20	1.31
10	332 2年国債	日本	国債証券	7,000,000	100.02 7,001,820	100.02 7,001,750	0.100000 2015/09/15	1.31
11	312 10年国債	日本	国債証券	6,000,000	105.90 6,354,000	105.98 6,358,980	1.200000 2020/12/20	1.19
12	299 10年国債	日本	国債証券	6,000,000	105.39 6,323,400	105.39 6,323,940	1.300000 2019/03/20	1.18
13	331 10年国債	日本	国債証券	6,000,000	100.42 6,025,260	100.62 6,037,200	0.600000 2023/09/20	1.13
14	104 5年国債	日本	国債証券	6,000,000	100.28 6,017,040	100.29 6,017,520	0.200000 2017/03/20	1.12
15	324 10年国債	日本	国債証券	5,000,000	102.77 5,138,860	102.95 5,147,850	0.800000 2022/06/20	0.96
16	325 10年国債	日本	国債証券	5,000,000	102.65 5,132,700	102.88 5,144,100	0.800000 2022/09/20	0.96
17	329 10年国債	日本	国債証券	5,000,000	102.30 5,115,050	102.55 5,127,600	0.800000 2023/06/20	0.96

18	326 10年国債	日本	国債証券	5,000,000	101.69 5,084,600	101.93 5,096,550	0.700000 2022/12/20	0.95
19	328 10年国債	日本	国債証券	5,000,000	100.67 5,033,850	100.92 5,046,350	0.600000 2023/03/20	0.94
20	102 5年国債	日本	国債証券	5,000,000	100.53 5,026,650	100.52 5,026,050	0.300000 2016/12/20	0.94
21	115 5年国債	日本	国債証券	5,000,000	100.17 5,008,650	100.21 5,010,650	0.200000 2018/09/20	0.93
22	335 2年国債	日本	国債証券	5,000,000	100.03 5,001,550	100.03 5,001,500	0.100000 2015/12/15	0.93
23	338 2年国債	日本	国債証券	5,000,000	100.03 5,001,800	100.02 5,001,300	0.100000 2016/03/15	0.93
24	53 20年国債	日本	国債証券	4,000,000	112.67 4,507,040	112.82 4,513,080	2.100000 2021/12/20	0.84
25	307 10年国債	日本	国債証券	4,000,000	106.21 4,248,480	106.20 4,248,360	1.300000 2020/03/20	0.79
26	305 10年国債	日本	国債証券	4,000,000	105.99 4,239,960	106.03 4,241,400	1.300000 2019/12/20	0.79
27	288 10年国債	日本	国債証券	4,000,000	105.32 4,212,800	105.24 4,209,720	1.700000 2017/09/20	0.79
28	289 10年国債	日本	国債証券	4,000,000	104.95 4,198,280	104.91 4,196,480	1.500000 2017/12/20	0.78
29	310 10年国債	日本	国債証券	4,000,000	104.59 4,183,840	104.65 4,186,000	1.000000 2020/09/20	0.78
30	147 20年国債	日本	国債証券	4,000,000	102.68 4,107,280	103.06 4,122,760	1.600000 2033/12/20	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	97.57%
合計	97.57%

(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（為替ヘッジあり）マザーファンド

(1) 投資状況（平成26年5月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	252,710,030	96.28
内 ユーロ	118,379,135	45.10
内 シンガポール	1,123,914	0.43
内 ノルウェー	410,806	0.16
内 スウェーデン	830,710	0.32
内 デンマーク	2,569,010	0.98
内 イギリス	16,329,185	6.22
内 スイス	890,526	0.34
内 ポーランド	1,114,334	0.42
内 カナダ	2,753,887	1.05
内 アメリカ	92,404,026	35.21
内 メキシコ	2,258,622	0.86
内 オーストラリア	13,645,875	5.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,755,325	3.72
純資産総額	262,465,355	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(売建)	253,178,146	96.46
内 日本	253,178,146	96.46

(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5月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	224,000	99.10 22,568,032	99.51 22,661,396	0.625000 2017/05/31	8.63
2	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	110,000	110.62 16,832,879	110.47 16,810,511	4.750000 2017/05/01	6.40
3	ITALIAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	100,000	112.39 15,546,908	112.65 15,582,874	4.250000 2019/09/01	5.94
4	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	124,000	109.92 13,856,969	109.98 13,864,911	4.625000 2016/11/15	5.28
5	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	78,000	111.04 11,980,927	111.20 11,998,190	4.100000 2018/07/30	4.57
6	BELGIUM GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	71,000	120.18 11,803,983	121.78 11,961,126	4.250000 2022/09/28	4.56
7	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	88,000	108.97 9,749,080	109.97 9,838,540	3.500000 2020/05/15	3.75

8	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	49,000	131.01 8,880,283	134.78 9,135,753	4.500000 2041/04/25	3.48
9	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	91,000	104.05 8,969,816	104.27 8,988,953	4.250000 2017/07/21	3.42
10	NETHERLANDS GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	62,000	102.79 8,816,086	103.34 8,863,599	1.250000 2018/01/15	3.38
11	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	46,000	132.44 8,427,395	135.69 8,634,453	4.750000 2035/04/25	3.29
12	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	86,000	97.37 8,513,262	97.96 8,564,407	0.625000 2018/04/30	3.26
13	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	72,000	101.60 7,437,291	103.08 7,545,327	2.750000 2023/11/15	2.87
14	FINNISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	44,000	115.15 7,008,992	116.44 7,087,448	3.500000 2021/04/15	2.70
15	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	30,000	134.70 6,872,528	136.44 6,961,305	6.000000 2028/12/07	2.65
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	44,000	102.73 6,253,229	104.79 6,378,307	2.250000 2024/05/25	2.43
17	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	67,000	90.07 6,134,865	92.00 6,266,322	2.875000 2043/05/15	2.39
18	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	23,000	137.50 5,378,463	138.35 5,411,712	8.000000 2021/06/07	2.06
19	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	51,000	103.06 5,343,621	103.00 5,340,199	2.125000 2015/12/31	2.03
20	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	47,000	105.45 5,038,565	106.03 5,066,373	2.750000 2019/02/15	1.93
21	AUSTRIA GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	26,000	130.30 4,686,487	132.27 4,757,448	4.850000 2026/03/15	1.81
22	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	30,000	108.23 4,491,561	108.06 4,484,464	4.250000 2016/10/31	1.71
23	UNITED KINGDOM GILT BOND	イギリス	国債証券	20,000	114.84 3,906,167	116.31 3,956,168	4.250000 2040/12/07	1.51
24	U.S. TREASURY BOND	アメリカ	国債証券	31,000	120.31 3,791,584	122.30 3,854,361	4.500000 2036/02/15	1.47
25	U.S. TREASURY NOTE	アメリカ	国債証券	36,000	102.69 3,758,244	102.76 3,760,805	1.750000 2016/05/31	1.43
26	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	21,000	128.21 3,724,410	129.20 3,753,227	6.000000 2029/01/31	1.43
27	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	31,000	93.78 2,726,731	94.71 2,753,887	1.500000 2023/06/01	1.05
28	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	25,000	114.64 2,715,127	115.93 2,745,535	5.750000 2022/07/15	1.05
29	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	121,000	113.40 2,542,635	114.57 2,569,010	3.000000 2021/11/15	0.98
30	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	15,000	109.57 2,273,647	109.53 2,272,837	3.750000 2017/01/04	0.87

(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	96.28%

合計	96.28%
----	--------

(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	ノルウェー・クローネ売/ 円買 2014年6月	売建	24,800	426,560	422,344	0.16%
		豪ドル売/円買 2014年6月	売建	145,288	13,754,610	13,750,056	5.24%
		シンガポール・ドル売/円 買 2014年6月	売建	14,200	1,156,420	1,151,478	0.44%
		スイス・フラン売/円買 2014年6月	売建	8,000	930,160	906,160	0.35%
		デンマーク・クローネ売/ 円買 2014年6月	売建	140,400	2,653,996	2,601,612	0.99%
		ユーロ売/円買 2014年6月	売建	856,630	121,212,956	118,471,929	45.14%
		カナダ・ドル売/円買 2014年6月	売建	29,550	2,758,788	2,770,312	1.06%
		英ポンド売/円買 2014年6 月	売建	96,890	16,727,089	16,474,206	6.28%
		米ドル売/円買 2014年6月	売建	908,250	92,499,547	92,314,530	35.17%
		メキシコ・ペソ売/円買 2014年6月	売建	294,410	2,314,551	2,325,839	0.89%
		ポーランド・ズロチ売/円 買 2014年6月	売建	34,000	1,148,520	1,135,940	0.43%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2014年6月	売建	55,800	871,630	853,740	0.33%

(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5月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	2,436,208,981	97.88
内 アメリカ	2,436,208,981	97.88
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	52,795,158	2.12
純資産総額	2,489,004,139	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)	5,082,500	0.20
内 日本	5,082,500	0.20

(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5月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	832,960	113.57 96,173,845	116.44 98,608,359	7.500000 2030/03/31	3.96
2	FED REPUBLIC OF BRAZIL	アメリカ	国債証券	600,000	100.52 61,316,229	102.00 62,215,920	4.250000 2025/01/07	2.50
3	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	500,000	102.25 51,973,675	107.25 54,515,175	5.000000 2020/04/29	2.19
4	Philippine Government International Bond	アメリカ	国債証券	278,000	158.50 44,794,445	160.37 45,324,348	9.500000 2030/02/02	1.82
5	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	336,000	127.50 43,551,144	130.50 44,575,876	6.750000 2034/09/27	1.79
6	Argentine Republic International Bond	アメリカ	国債証券	469,000	94.75 45,175,416	92.25 43,983,453	8.750000 2017/06/02	1.77
7	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	382,000	111.97 43,484,505	113.15 43,940,806	5.125000 2020/01/15	1.77
8	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	103.37 42,036,410	105.12 42,748,030	4.000000 2023/10/02	1.72
9	REPUBLIC OF COLOMBIA	アメリカ	国債証券	400,000	101.90 41,436,616	104.00 42,290,560	4.000000 2024/02/26	1.70
10	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	400,000	98.50 40,054,040	102.75 41,782,260	4.500000 2022/04/04	1.68
11	Ukraine Government International Bond	アメリカ	国債証券	400,000	84.00 34,157,760	95.40 38,793,456	7.750000 2020/09/23	1.56
12	Venezuela Government International Bond	アメリカ	国債証券	405,000	94.00 38,701,962	93.00 38,290,239	11.750000 2026/10/21	1.54
13	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	246,000	144.50 36,137,080	147.75 36,949,851	8.300000 2031/08/15	1.48
14	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	300,000	112.95 34,447,491	113.65 34,660,977	6.750000 2018/04/03	1.39
15	Croatia Government International Bond	アメリカ	国債証券	300,000	110.25 33,624,045	112.25 34,234,005	6.625000 2020/07/14	1.38
16	Philippine Government International Bond	アメリカ	国債証券	300,000	106.00 32,327,880	107.62 32,823,472	4.000000 2021/01/15	1.32
17	Peruvian Government International Bond	アメリカ	国債証券	203,000	153.50 31,677,764	153.50 31,677,764	8.750000 2033/11/21	1.27

18	FED REPUBLIC OF BRAZIL	アメリカ	国債証券	209,000	139.12 29,559,805	140.25 29,798,833	8.250000 2034/01/20	1.20
19	Ukraine Government International Bond	アメリカ	国債証券	300,000	84.00 25,618,320	94.63 28,860,257	6.750000 2017/11/14	1.16
20	Philippine Government International Bond	アメリカ	国債証券	200,000	140.62 28,591,875	141.62 28,795,195	7.750000 2031/01/14	1.16
21	Indonesia Government International Bond	アメリカ	国債証券	200,000	133.00 27,041,560	136.75 27,804,010	8.500000 2035/10/12	1.12
22	Peruvian Government International Bond	アメリカ	国債証券	200,000	133.00 27,041,560	133.50 27,143,220	7.350000 2025/07/21	1.09
23	Hungary Government International Bond	アメリカ	国債証券	232,000	112.50 26,533,260	113.75 26,828,074	6.375000 2021/03/29	1.08
24	FED REPUBLIC OF BRAZIL	アメリカ	国債証券	201,000	131.50 26,870,262	131.25 26,819,178	8.875000 2019/10/14	1.08
25	Philippine Government International Bond	アメリカ	国債証券	200,000	127.50 25,923,300	130.12 26,457,015	6.375000 2034/10/23	1.06
26	Russian Foreign Bond - Eurobond	アメリカ	国債証券	150,000	163.00 24,855,870	173.10 26,396,019	12.750000 2028/06/24	1.06
27	Venezuela Government International Bond	アメリカ	国債証券	354,000	74.00 26,630,853	73.30 26,378,940	6.000000 2020/12/09	1.06
28	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	212,000	118.50 25,539,025	121.75 26,239,462	6.050000 2040/01/11	1.05
29	Turkey Government International Bond	アメリカ	国債証券	212,000	121.67 26,223,298	121.62 26,212,522	7.375000 2025/02/05	1.05
30	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	182,000	134.75 24,931,606	139.50 25,810,457	7.500000 2033/04/08	1.04

(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	97.88%
合計	97.88%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(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6月	買建	50,000	5,093,000	5,082,500	0.20%

(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。

国内株式マザーファンド

(1) 投資状況（平成26年5月30日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	86,059,380	56.55
内 日本	86,059,380	56.55
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	66,128,224	43.45
純資産総額	152,187,604	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)	152,590,500	100.26
内 日本	152,590,500	100.26

(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5月30日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	324 2年国債	日本	国債証券	21,000,000	100.02 21,005,670	100.02 21,005,040	0.100000 2015/01/15	13.80
2	323 2年国債	日本	国債証券	16,000,000	100.02 16,003,680	100.02 16,003,360	0.100000 2014/12/15	10.52
3	322 2年国債	日本	国債証券	16,000,000	100.02 16,003,200	100.01 16,002,880	0.100000 2014/11/15	10.52
4	88 5年国債	日本	国債証券	13,000,000	100.37 13,048,230	100.34 13,044,850	0.500000 2015/03/20	8.57
5	327 2年国債	日本	国債証券	10,000,000	100.02 10,002,700	100.02 10,002,500	0.100000 2015/04/15	6.57
6	320 2年国債	日本	国債証券	5,000,000	100.01 5,000,650	100.01 5,000,550	0.100000 2014/09/15	3.29
7	318 2年国債	日本	国債証券	5,000,000	100.00 5,000,350	100.00 5,000,200	0.100000 2014/07/15	3.29

(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	56.55%
合計	56.55%

(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6月	買建	127	147,280,510	152,590,500	100.26%

(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5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	48,311,678	48.70
内 アメリカ	48,311,678	48.70
投資証券	40,606,460	40.93
内 アイルランド	30,761,604	31.01
内 アメリカ	9,844,856	9.92
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,285,941	10.37
純資産総額	99,204,079	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)	9,749,194	9.83
内 アメリカ	9,749,194	9.83
為替予約取引(買建)	7,012,470	7.07
内 日本	7,012,470	7.07

(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5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	SPDR S&P 500 ETF TRUST	アメリカ	投資信託 受益証券	2,470	19,100.89 47,179,217	19,559.38 48,311,678	48.70
2	ISHARES MSCI EUROPE UCITS ET	アイルラン ド	投資証券	10,145	2,935.22 29,778,399	3,032.19 30,761,604	31.01
3	ISHARES MSCI PACIFIC EX JPN	アメリカ	投資証券	1,060	5,004.72 5,305,005	5,113.49 5,420,308	5.46
4	ISHARES MSCI CANADA ETF	アメリカ	投資証券	1,420	3,112.82 4,420,217	3,115.87 4,424,548	4.46

(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	48.70%
投資証券	40.93%
合計	89.63%

(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6月	買建	1	9,526,813	9,749,194	9.83%
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2014年6月	買建	69,000	7,027,650	7,012,470	7.07%

(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。

新興国株式マザーファンド

(1) 投資状況（平成26年5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	74,993,972	87.57
内 アメリカ	74,993,972	87.57
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,647,985	12.43
純資産総額	85,641,957	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)	10,566,540	12.34
内 アメリカ	10,566,540	12.34
為替予約取引(買建)	4,400,579	5.14
内 日本	4,400,579	5.14

(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5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	ISHARES MSCI EMERGING MKT ET	アメリカ	投資証券	17,100	4,249.99 72,676,429	4,385.61 74,993,972	87.57

(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	87.57%
合計	87.57%

(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	MINI MSCI EMG MKT 2014 年6月	買建	2	10,236,145	10,566,540	12.34%

為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2014年6月	買建	43,300	4,410,105	4,400,579	5.14%
--------	----	-----------------	----	--------	-----------	-----------	-------

(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REITマザーファンド

(1) 投資状況 (平成26年5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	72,944,370	95.82
内 日本	72,944,370	95.82
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,185,902	4.18
純資産総額	76,130,272	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(%)
不動産投信指数先物取引(買建)	3,126,000	4.11
内 日本	3,126,000	4.11

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

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

(注3) 不動産投信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5月30日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本ビルファンド	日本	投資証券	12	566,000.00 6,792,000	596,000.00 7,152,000	9.39
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	11	546,000.00 6,006,000	595,000.00 6,545,000	8.60
3	日本リテールファンド	日本	投資証券	21	205,444.19 4,314,328	223,900.00 4,701,900	6.18
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	21	154,800.00 3,250,800	162,900.00 3,420,900	4.49
5	日本プロロジスリート	日本	投資証券	14	213,300.00 2,986,200	222,800.00 3,119,200	4.10
6	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	12	232,600.00 2,791,200	251,200.00 3,014,400	3.96

7	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	7	359,500.00 2,516,500	365,500.00 2,558,500	3.36
8	オリックス不動産投資	日本	投資証券	18	129,932.83 2,338,791	135,900.00 2,446,200	3.21
9	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	4	534,000.00 2,136,000	552,000.00 2,208,000	2.90
10	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	4	513,000.00 2,052,000	516,000.00 2,064,000	2.71
11	GLP投資法人	日本	投資証券	19	103,763.89 1,971,514	107,800.00 2,048,200	2.69
12	森トラスト総合リート	日本	投資証券	12	154,600.00 1,855,200	160,800.00 1,929,600	2.53
13	産業ファンド	日本	投資証券	2	875,000.00 1,750,000	908,000.00 1,816,000	2.39
14	森ヒルズリート	日本	投資証券	13	134,800.00 1,752,400	137,700.00 1,790,100	2.35
15	NMF投資法人	日本	投資証券	15	107,000.00 1,605,000	116,100.00 1,741,500	2.29
16	API投資法人	日本	投資証券	2	858,000.00 1,716,000	854,000.00 1,708,000	2.24
17	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	3	513,000.00 1,539,000	532,000.00 1,596,000	2.10
18	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	7	222,400.00 1,556,800	227,300.00 1,591,100	2.09
19	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	11	135,200.00 1,487,200	138,500.00 1,523,500	2.00
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	4	362,500.00 1,450,000	371,000.00 1,484,000	1.95
21	野村不動産オフィスF	日本	投資証券	3	438,500.00 1,315,500	474,500.00 1,423,500	1.87
22	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	3	418,000.00 1,254,000	445,000.00 1,335,000	1.75
23	大和ハウズリート	日本	投資証券	3	411,000.00 1,233,000	437,000.00 1,311,000	1.72
24	東急リアル・エステート	日本	投資証券	9	130,400.00 1,173,600	138,900.00 1,250,100	1.64
25	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	23	45,350.00 1,043,050	47,450.00 1,091,350	1.43
26	福岡リート投資法人	日本	投資証券	6	162,900.00 977,400	173,600.00 1,041,600	1.37
27	イオンリート投資	日本	投資証券	8	130,400.00 1,043,200	127,900.00 1,023,200	1.34
28	トップリート投資法人	日本	投資証券	2	448,000.00 896,000	469,000.00 938,000	1.23
29	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	6	141,800.00 850,800	150,000.00 900,000	1.18
30	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	13	63,100.00 820,300	64,500.00 838,500	1.10

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 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	95.82%
合計	95.82%

(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
不動産投信指数先物取引	日本	東証REIT指数先物 2014年6月	買建	2	2,978,000	3,126,000	4.11%

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

(注2) 不動産投信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REITマザーファンド

(1) 投資状況（平成26年5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	163,602,340	98.45
内 香港	3,240,792	1.95
内 シンガポール	6,715,097	4.04
内 イギリス	11,631,052	7.00
内 ベルギー	2,425,755	1.46
内 フランス	8,961,335	5.39
内 カナダ	5,470,583	3.29
内 アメリカ	109,521,498	65.90
内 オーストラリア	15,636,228	9.41
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,581,865	1.55
純資産総額	166,184,205	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5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	700	16,816.69 11,771,746	16,803.38 11,762,367	7.08
2	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	230	27,430.83 6,309,093	28,094.82 6,461,809	3.89
3	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	500	10,694.63 5,347,316	10,821.70 5,410,854	3.26
4	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	300	17,607.51 5,282,254	17,281.18 5,184,355	3.12
5	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	1,200	4,190.42 5,028,510	4,202.62 5,043,149	3.03
6	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	800	6,256.15 5,004,925	6,260.22 5,008,178	3.01
7	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	400	12,067.04 4,826,817	12,146.33 4,858,535	2.92
8	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	700	6,900.68 4,830,477	6,754.29 4,728,003	2.85
9	HCP INC	アメリカ	投資証券	1,100	4,316.48 4,748,132	4,230.07 4,653,080	2.80
10	WESTFIELD GROUP	オーストラ リア	投資証券	4,500	1,006.97 4,531,410	1,027.82 4,625,192	2.78
11	HEALTH CARE REIT INC	アメリカ	投資証券	700	6,452.36 4,516,652	6,371.03 4,459,723	2.68
12	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	2,000	2,173.49 4,346,982	2,216.18 4,432,376	2.67
13	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	300	14,141.92 4,242,577	14,268.99 4,280,699	2.58
14	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	2,070	1,832.84 3,794,289	1,806.14 3,738,717	2.25
15	FEDERAL REALTY INVS TRUST	アメリカ	投資証券	300	12,169.71 3,650,916	12,097.54 3,629,262	2.18
16	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	2,770	1,187.08 3,288,293	1,219.40 3,377,743	2.03
17	GENERAL GROWTH PROPERTIES	アメリカ	投資証券	1,400	2,379.86 3,331,805	2,404.25 3,365,963	2.03
18	MACERICH CO	アメリカ	投資証券	500	6,651.61 3,325,807	6,681.09 3,340,548	2.01
19	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	300	10,937.59 3,281,280	11,080.94 3,324,282	2.00
20	KIMCO REALTY CORP	アメリカ	投資証券	1,400	2,358.51 3,301,917	2,316.83 3,243,564	1.95
21	LINK REIT	香港	投資証券	6,000	500.80 3,004,812	540.13 3,240,792	1.95
22	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	159	18,259.15 2,903,205	18,251.01 2,901,912	1.75
23	RIOCAN REIT	カナダ	投資証券	1,100	2,560.09 2,816,139	2,581.10 2,839,211	1.71

24	WESTFIELD RETAIL TRUST	オーストラリア	投資証券	8,800	302.18 2,659,261	306.92 2,700,942	1.63
25	CAPITAMALL TRUST	シンガポール	投資証券	16,000	163.84 2,621,475	167.08 2,673,386	1.61
26	HAMMERSON PLC	イギリス	投資証券	2,630	991.16 2,606,823	1,010.21 2,656,868	1.60
27	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	600	4,494.38 2,696,633	4,407.97 2,644,787	1.59
28	H&R REIT	カナダ	投資証券	1,200	2,180.61 2,616,741	2,192.81 2,631,372	1.58
29	DDR CORP	アメリカ	投資証券	1,500	1,757.70 2,636,552	1,746.51 2,619,778	1.58
30	KLEPIERRE	フランス	投資証券	510	4,640.97 2,366,895	4,901.03 2,499,526	1.50

(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	98.45%
合計	98.45%

(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。

[次へ](#)

(参考情報) 運用実績

2014年5月30日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,218円
純資産総額	9.1億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	1.2%
3か月間	1.4%
6か月間	1.2%
1年間	-
3年間	-
5年間	-
設定来	2.2%

※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

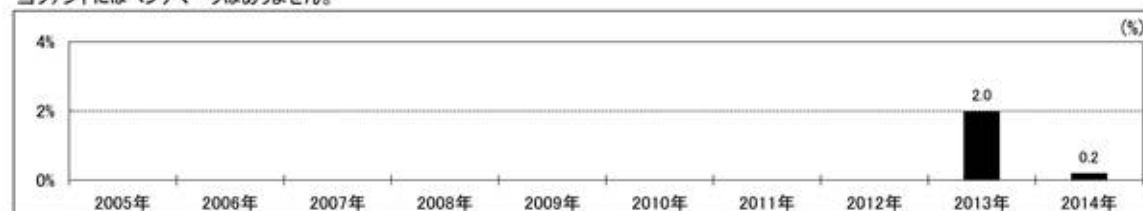
※比率は、純資産総額に対するものです。

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
国内債券MF	46.0%	国内債券	215	48.0%	日本円	80.2%	ミニTPX先物 2606月	日本	5.6%
先進国債券(為替ヘッジあり)MF	22.1%	外国債券	162	26.7%	米ドル	16.4%	ISHARES MSCI EMERGING MKT ET	アメリカ	3.4%
国内REITMF	6.0%	外国投資信託等	5	8.0%	ユーロ	2.1%	SPDR S&P 500 ETF TRUST	アメリカ	2.5%
国内株式MF	5.6%	国内リート・先物	45	6.0%	豪ドル	0.5%	ISHARES MSCI EUROPE UCITS ET	アイルランド	1.6%
新興国債券MF	5.5%	国内株式先物	1	5.6%	英ポンド	0.4%	日本ビルファンド	日本	0.6%
先進国株式MF	5.2%	外国リート	51	5.0%	シンガポール・ドル	0.2%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.5%
先進国REITMF	5.1%	外国株式先物	2	1.0%	カナダ・ドル	0.2%	S&P500 E-MINI FUTURE 201406	アメリカ	0.5%
新興国株式MF	3.8%				香港ドル	0.1%	MINI MSCI EMG MKT 201406	アメリカ	0.5%
					デンマーク・クローネ	0.0%	日本リテールファンド	日本	0.4%
		コール・ローン、その他		6.6%	その他	0.0%	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.4%
合計	99.3%	合計	481	-	合計	100.0%	合計		15.9%

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄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(10月21日)から年末、2014年は5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。

第2 【管理及び運営】

2 【換金（解約）手続等】

< 訂正前 >

< 略 >

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

解約価額（基準価額）は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

< 略 >

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

< 訂正前 >

< 略 >

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができるほか、原則として計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

< 略 >

< 訂正後 >

< 略 >

基準価額は、販売会社または委託会社に問合わせることにより知ることができます。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

< 略 >

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期計算期間（平成25年10月21日から平成26年5月8日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

りそな ダイナミック・アロケーション・ファンド

(1) 【貸借対照表】

	第1期	
	平成26年5月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		8,122,209
親投資信託受益証券		947,007,794
流動資産合計		955,130,003
資産合計		955,130,003
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		18,843
未払委託者報酬		546,651
その他未払費用		3,730
流動負債合計		569,224
負債合計		569,224
純資産の部		
元本等		
元本	1	943,823,180
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		10,737,599
（分配準備積立金）		3,278,998
元本等合計		954,560,779
純資産合計		954,560,779
負債純資産合計		955,130,003

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	第1期	
	自 平成25年10月21日	至 平成26年5月8日
	金額(円)	
営業収益		
受取利息		1,791
有価証券売買等損益		6,034,794
営業収益合計		6,036,585
営業費用		
受託者報酬		94,910
委託者報酬		2,753,717
その他費用		18,099
営業費用合計		2,866,726
営業利益		3,169,859
経常利益		3,169,859
当期純利益		3,169,859
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		109,139
剰余金増加額又は欠損金減少額		7,653,419
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額		7,653,419
剰余金減少額又は欠損金増加額		194,818
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額		194,818
分配金	1	-
期末剰余金又は期末欠損金()		10,737,599

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第1期 自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間 当ファンドの第1期計算期間は、平成25年10月21日から平成26年5月8日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期 平成26年5月8日現在
1. 1期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	964,865,153円
期中一部解約元本額	22,041,973円
2. 計算期間末日における受益権の総数	943,823,180口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期 自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1 分配金の計算過程	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（931円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（3,278,067円）、投資信託約款に規定される収益調整金（7,458,601円）及び分配準備積立金（0円）より分配対象額は10,737,599円（1万口当たり113.77円）であり、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	第1期 自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第1期 平成26年5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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第1期 平成26年5月8日現在	
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	
親投資信託受益証券		9,258,422
合計		9,258,422

(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

第1期 平成26年5月8日現在
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	第1期 平成26年5月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0114円 (10,114円)

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額 (円)	備考
親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	56,527,439	59,794,724	
	先進国株式マザーファンド	46,218,037	55,937,690	
	新興国株式マザーファンド	37,608,058	41,327,494	
	国内債券マザーファンド	402,186,753	410,833,768	
	新興国債券マザーファンド	57,228,032	60,524,366	
	先進国債券（為替ヘッジあり）マザーファンド	191,025,135	197,691,912	
	先進国REITマザーファンド	47,686,726	56,704,285	
	国内REITマザーファンド	62,941,029	64,193,555	
親投資信託受益証券 合計			947,007,794	
合計			947,007,794	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「国内債券マザーファンド」受益証券、「先進国債券（為替ヘッジあり）マザーファンド」受益証券、「新興国債券マザーファンド」受益証券、「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REITマザーファンド」受益証券及び「先進国REITマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同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5月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		11,003,583
国債証券		510,990,500
未収利息		979,982
前払費用		460,441
流動資産合計		523,434,506
資産合計		523,434,506
負債の部		
流動負債		
未払金		2,151,720
流動負債合計		2,151,720
負債合計		2,151,720
純資産の部		
元本等		
元本	1	510,298,968
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		10,983,818
元本等合計		521,282,786
純資産合計		521,282,786
負債純資産合計		523,434,506

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5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5月8日現在
1. 1 期首	平成25年10月21日
期首元本額	27,019,970円
期中追加設定元本額	596,852,721円
期中一部解約元本額	113,573,723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）	17,617,843円

スマート・ミックス(為替ヘッジなし)	508,984円
スマート・ミックス・Dガード(為替ヘッジなし)	3,775,095円
スマート・アロケーション・Dガード	9,077,945円
りそな ダイナミック・アロケーション・ファンド	402,186,753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)	11,757,361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)	23,795,344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)	31,679,643円
計	510,298,968円
2. 期末日における受益権の総数	510,298,968口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細を附属明細表に記載しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成26年5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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成26年5月8日現在
--	-------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	274,020
合計	274,020

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成25年6月10日から平成26年5月8日まで）を指しております。

（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5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5月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0215円 (10,215円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 （円）	評価額 （円）	備考
国債証券	3 2 9 2年国債	1,000,000	1,001,360	
	3 3 0 2年国債	1,000,000	1,001,400	
	3 3 1 2年国債	3,000,000	3,000,750	
	3 3 2 2年国債	7,000,000	7,001,820	
	3 3 3 2年国債	1,000,000	1,000,280	
	3 3 4 2年国債	4,000,000	4,001,200	
	3 3 5 2年国債	5,000,000	5,001,550	
	3 3 7 2年国債	2,000,000	2,000,700	
	3 3 8 2年国債	5,000,000	5,001,800	
	3 3 9 2年国債	2,000,000	2,000,560	
	8 9 5年国債	4,000,000	4,014,360	
	9 1 5年国債	3,000,000	3,013,020	
	9 2 5年国債	3,000,000	3,008,940	
	9 3 5年国債	3,000,000	3,020,220	
	9 4 5年国債	9,000,000	9,075,150	
	9 5 5年国債	1,000,000	1,009,630	
	9 6 5年国債	3,000,000	3,023,310	
	9 7 5年国債	2,000,000	2,013,240	
	9 8 5年国債	3,000,000	3,013,560	
	9 9 5年国債	3,000,000	3,021,870	
	1 0 0 5年国債	2,000,000	2,009,880	
	1 0 1 5年国債	9,000,000	9,071,370	
	1 0 2 5年国債	5,000,000	5,026,650	
	1 0 3 5年国債	4,000,000	4,022,760	
1 0 4 5年国債	6,000,000	6,017,040		
1 0 5 5年国債	3,000,000	3,008,340		
1 0 6 5年国債	10,000,000	10,026,700		

107	5年国債	4,000,000	4,010,040
108	5年国債	3,000,000	2,996,760
109	5年国債	3,000,000	2,995,380
110	5年国債	2,000,000	2,012,260
111	5年国債	4,000,000	4,039,840
112	5年国債	3,000,000	3,030,600
113	5年国債	3,000,000	3,018,360
114	5年国債	7,000,000	7,042,420
115	5年国債	5,000,000	5,008,650
116	5年国債	4,000,000	4,004,560
117	5年国債	5,000,000	5,003,600
1	40年国債	1,000,000	1,171,810
3	40年国債	1,000,000	1,120,110
4	40年国債	2,000,000	2,239,260
5	40年国債	1,000,000	1,062,970
6	40年国債	2,000,000	2,066,980
276	10年国債	2,000,000	2,048,820
280	10年国債	2,000,000	2,076,560
281	10年国債	3,000,000	3,121,140
282	10年国債	7,000,000	7,266,140
285	10年国債	1,000,000	1,045,690
287	10年国債	8,000,000	8,446,000
288	10年国債	4,000,000	4,212,800
289	10年国債	4,000,000	4,198,280
290	10年国債	3,000,000	3,145,530
293	10年国債	3,000,000	3,202,680
294	10年国債	1,000,000	1,063,480
295	10年国債	3,000,000	3,165,930
296	10年国債	1,000,000	1,058,000
297	10年国債	7,000,000	7,391,930
299	10年国債	6,000,000	6,323,400
300	10年国債	1,000,000	1,063,520
301	10年国債	2,000,000	2,133,040
302	10年国債	2,000,000	2,122,920
303	10年国債	3,000,000	3,191,700
304	10年国債	2,000,000	2,117,200
305	10年国債	2,000,000	2,120,820
306	10年国債	1,000,000	1,067,890
307	10年国債	4,000,000	4,248,480
308	10年国債	2,000,000	2,126,940
309	10年国債	3,000,000	3,154,320
310	10年国債	4,000,000	4,183,840
311	10年国債	3,000,000	3,100,350
312	10年国債	6,000,000	6,354,000
313	10年国債	2,000,000	2,132,900
314	10年国債	3,000,000	3,159,060
315	10年国債	1,000,000	1,059,300
316	10年国債	3,000,000	3,157,110
317	10年国債	3,000,000	3,155,730
318	10年国債	2,000,000	2,089,500
319	10年国債	2,000,000	2,103,360
320	10年国債	2,000,000	2,088,600
321	10年国債	3,000,000	3,131,100

3 2 2	1 0年国債	2,000,000	2,072,200	
3 2 3	1 0年国債	6,000,000	6,213,600	
3 2 4	1 0年国債	2,000,000	2,054,740	
3 2 5	1 0年国債	5,000,000	5,132,700	
3 2 6	1 0年国債	5,000,000	5,084,600	
3 2 7	1 0年国債	3,000,000	3,075,540	
3 2 8	1 0年国債	5,000,000	5,033,850	
3 2 9	1 0年国債	5,000,000	5,115,050	
3 3 0	1 0年国債	3,000,000	3,065,370	
3 3 1	1 0年国債	3,000,000	3,010,650	
3 3 2	1 0年国債	7,000,000	7,012,740	
3 3 3	1 0年国債	4,000,000	4,000,000	
9	3 0年国債	1,000,000	1,007,430	
1 0	3 0年国債	1,000,000	953,110	
1 1	3 0年国債	1,000,000	1,049,970	
1 2	3 0年国債	2,000,000	2,228,500	
1 4	3 0年国債	1,000,000	1,161,670	
1 6	3 0年国債	1,000,000	1,175,200	
1 7	3 0年国債	1,000,000	1,157,160	
1 8	3 0年国債	1,000,000	1,138,840	
2 0	3 0年国債	1,000,000	1,173,140	
2 1	3 0年国債	1,000,000	1,136,110	
2 3	3 0年国債	1,000,000	1,171,850	
2 5	3 0年国債	1,000,000	1,133,140	
2 6	3 0年国債	2,000,000	2,304,380	
2 7	3 0年国債	1,000,000	1,171,960	
2 8	3 0年国債	1,000,000	1,172,590	
2 9	3 0年国債	2,000,000	2,308,760	
3 0	3 0年国債	2,000,000	2,271,160	
3 2	3 0年国債	2,000,000	2,274,760	
3 3	3 0年国債	3,000,000	3,222,450	
3 4	3 0年国債	2,000,000	2,233,780	
3 5	3 0年国債	2,000,000	2,148,140	
3 6	3 0年国債	4,000,000	4,291,720	
3 7	3 0年国債	2,000,000	2,100,640	
3 8	3 0年国債	1,000,000	1,027,310	
3 9	3 0年国債	2,000,000	2,098,300	
4 0	3 0年国債	2,000,000	2,051,220	
4 2	3 0年国債	2,000,000	2,001,980	
3 8	利付国債 2 0年	2,000,000	2,196,720	
4 2	2 0年国債	1,000,000	1,117,000	
4 3	2 0年国債	1,000,000	1,144,060	
4 4	2 0年国債	2,000,000	2,263,580	
4 6	2 0年国債	1,000,000	1,117,730	
5 0	2 0年国債	1,000,000	1,106,800	
5 1	2 0年国債	2,000,000	2,230,460	
5 2	2 0年国債	1,000,000	1,123,970	
5 3	2 0年国債	4,000,000	4,507,040	
5 5	2 0年国債	2,000,000	2,242,060	
5 8	2 0年国債	2,000,000	2,232,720	
6 1	2 0年国債	1,000,000	1,041,070	
6 2	2 0年国債	1,000,000	1,023,010	
6 3	2 0年国債	1,000,000	1,111,290	

68	20年国債	1,000,000	1,152,620
69	20年国債	1,000,000	1,143,290
70	20年国債	1,000,000	1,174,310
71	20年国債	1,000,000	1,154,660
72	20年国債	1,000,000	1,146,290
74	20年国債	2,000,000	2,295,760
75	20年国債	3,000,000	3,448,050
80	20年国債	1,000,000	1,150,800
82	20年国債	1,000,000	1,151,550
83	20年国債	1,000,000	1,152,150
84	20年国債	3,000,000	3,422,370
85	20年国債	1,000,000	1,152,610
86	20年国債	2,000,000	2,350,280
88	20年国債	1,000,000	1,176,600
90	20年国債	1,000,000	1,165,320
91	20年国債	1,000,000	1,176,640
92	20年国債	1,000,000	1,153,510
93	20年国債	1,000,000	1,141,200
94	20年国債	1,000,000	1,153,540
95	20年国債	3,000,000	3,533,820
97	20年国債	1,000,000	1,166,150
98	20年国債	1,000,000	1,153,410
99	20年国債	2,000,000	2,306,340
100	20年国債	1,000,000	1,165,160
101	20年国債	1,000,000	1,191,380
102	20年国債	2,000,000	2,382,980
103	20年国債	1,000,000	1,178,190
105	20年国債	1,000,000	1,151,850
106	20年国債	2,000,000	2,330,600
107	20年国債	2,000,000	2,300,940
108	20年国債	1,000,000	1,123,300
109	20年国債	1,000,000	1,122,200
110	20年国債	2,000,000	2,299,400
111	20年国債	1,000,000	1,162,830
112	20年国債	2,000,000	2,297,760
113	20年国債	2,000,000	2,295,960
114	20年国債	2,000,000	2,293,920
115	20年国債	1,000,000	1,161,220
116	20年国債	2,000,000	2,320,500
117	20年国債	1,000,000	1,145,830
118	20年国債	1,000,000	1,129,320
119	20年国債	2,000,000	2,200,580
120	20年国債	1,000,000	1,070,610
121	20年国債	1,000,000	1,112,450
122	20年国債	2,000,000	2,195,600
123	20年国債	2,000,000	2,280,840
124	20年国債	2,000,000	2,251,180
125	20年国債	1,000,000	1,153,940
126	20年国債	1,000,000	1,123,170
127	20年国債	1,000,000	1,108,230
128	20年国債	3,000,000	3,316,860
131	20年国債	2,000,000	2,145,200
132	20年国債	2,000,000	2,139,140

133	20年国債	1,000,000	1,085,640	
134	20年国債	1,000,000	1,082,650	
135	20年国債	1,000,000	1,066,460	
136	20年国債	2,000,000	2,102,160	
137	20年国債	1,000,000	1,064,080	
138	20年国債	1,000,000	1,031,580	
139	20年国債	1,000,000	1,047,800	
140	20年国債	4,000,000	4,240,280	
141	20年国債	1,000,000	1,056,760	
142	20年国債	2,000,000	2,146,600	
143	20年国債	2,000,000	2,073,580	
145	20年国債	2,000,000	2,099,940	
146	20年国債	1,000,000	1,046,480	
147	20年国債	4,000,000	4,107,280	
148	20年国債	2,000,000	2,013,860	
国債証券 合計			510,990,500	
合計			510,990,500	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

[次へ](#)

「先進国債券（為替ヘッジあり）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5月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		10,970,199
コール・ローン		3,263,572
国債証券		247,214,902
派生商品評価勘定		508,065
未収入金		1,177,751
未収利息		1,302,964
前払費用		1,220,240
流動資産合計		265,657,693
資産合計		265,657,693
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		46,203
未払金		10,177,060
流動負債合計		10,223,263
負債合計		10,223,263
純資産の部		
元本等		
元本	1	246,817,782
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,616,648
元本等合計		255,434,430
純資産合計		255,434,430
負債純資産合計		265,657,693

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 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）、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。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 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5月8日現在
1. 1 期首	平成25年10月21日
期首元本額	24,178,702円
期中追加設定元本額	268,445,103円
期中一部解約元本額	45,806,023円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
5 資産(為替ヘッジあり)資金 抛出用ファンド(適格機関投資 家専用)	14,700,000円
スマート・ミックス・Dガード (為替ヘッジあり)	17,541,120円
りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	191,025,135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)	23,551,527円
計	246,817,782円
2. 期末日における受益権の総数	246,817,782口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産について為替変動リスクを回避すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--------------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成26年5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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成26年5月8日現在	
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	
国債証券		3,448,984
合計		3,448,984

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成25年7月10日から平成26年5月8日まで）を指しております。

(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5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	250,399,319	-	249,937,457	461,862
アメリカ・ドル	90,852,674	-	90,549,742	302,932
イギリス・ポンド	16,706,752	-	16,727,089	20,337
オーストラリア・ドル	11,862,448	-	11,857,091	5,357
カナダ・ドル	3,400,341	-	3,412,308	11,967
シンガポール・ドル	897,197	-	896,390	807

スイス・フラン	930,640	-	930,160	480
スウェーデン・クローナ	799,437	-	794,512	4,925
デンマーク・クローネ	2,118,289	-	2,116,270	2,019
ノルウェー・クローネ	425,843	-	426,560	717
ポーランド・ズロチ	1,144,093	-	1,148,520	4,427
メキシコ・ペソ	1,378,319	-	1,383,054	4,735
ユーロ	119,883,286	-	119,695,761	187,525
合計	250,399,319	-	249,937,457	461,862

(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5月8日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0349円 (10,349円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	4.625% U.S. TREASURY NOTE 20161115	124,000.000	136,307.000	
		2.75% U.S. TREASURY NOTE 20190215	59,000.000	62,217.270	
		3.5% U.S. TREASURY NOTE 20200515	88,000.000	95,898.880	
		2.125% U.S. TREASURY NOTE 20151231	59,000.000	60,808.940	
		1.75% U.S. TREASURY NOTE 20160531	36,000.000	36,968.760	

	0.625% U.S. TREASURY NOTE 20170531	224,000.000	221,995.200	
	0.625% U.S. TREASURY NOTE 20180430	86,000.000	83,742.500	
	2.75% U.S. TREASURY NOTE 20231115	72,000.000	73,158.480	
	4.5% U.S. TREASURY BOND 20360215	43,000.000	51,734.160	
	2.875% U.S. TREASURY BOND 20430515	67,000.000	60,346.900	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 883,178.090 (89,978,184)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	8% UNITED KINGDOM GILT BOND 20210607	23,000.000	31,625.000	
	6% UNITED KINGDOM GILT BOND 20281207	30,000.000	40,410.000	
	4.25% UNITED KINGDOM GILT BOND 20401207	20,000.000	22,968.000	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 95,003.000 (16,408,918)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20220715	25,000.000	28,661.750	
	4.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20170721	91,000.000	94,688.230	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 123,349.980 (11,721,949)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20230601	38,000.000	35,637.540	
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 35,637.540 (3,330,328)	
シンガポール・ドル		シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	2.5% SINGAPORE GOVERNMENT 20190601	10,000.000	10,552.700	
シンガポール・ドル	小計		シンガポール・ドル 10,552.700 (860,362)	
スイス・フラン		スイス・フラン	スイス・フラン	
	2.25% SWISS GOVERNMENT BOND 20200706	7,000.000	7,855.750	
スイス・フラン	小計		スイス・フラン 7,855.750 (913,309)	
スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	
	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	35,000.000	42,486.500	
スウェーデン・クローナ	小計		スウェーデン・クローナ 42,486.500 (665,339)	
デンマーク・クローネ		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	3% DANISH GOVERNMENT BOND 20211115	96,000.000	108,684.480	
デンマーク・クローネ	小計		デンマーク・クローネ	

			108,684.480 (2,062,831)
ノルウェー・ク ローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	ノルウェー・クローネ 22,000.000	ノルウェー・クローネ 23,893.980
ノルウェー・クローネ	小計		ノルウェー・クローネ 23,893.980 (411,693)
ポーランド・ズロ チ	5.5% POLAND GOVERNMENT BOND 20191025	ポーランド・ズロチ 30,000.000	ポーランド・ズロチ 32,972.400
ポーランド・ズロチ	小計		ポーランド・ズロチ 32,972.400 (1,116,775)
メキシコ・ペソ	6.25% MEXICAN FIXED RATE BONOS 20160616	メキシコ・ペソ 163,000.000	メキシコ・ペソ 170,674.040
メキシコ・ペソ	小計		メキシコ・ペソ 170,674.040 (1,343,205)
ユーロ	2.75% GERMAN GOVERNMENT BOND 20160408	ユーロ 6,000.000	ユーロ 6,295.560
	4.75% FRENCH GOVERNMENT BOND 20350425	46,000.000	60,922.400
	4.5% FRENCH GOVERNMENT BOND 20410425	49,000.000	64,196.370
	2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	49,000.000	50,342.110
	0.75% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20150415	18,000.000	18,097.740
	1.25% NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 20180115	62,000.000	63,732.280
	4.25% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20190901	100,000.000	112,390.000
	4.75% ITALIAN GOVERNMENT BOND 20170501	110,000.000	121,686.400
	4.25% BELGIUM GOVERNMENT BOND 20220928	71,000.000	85,332.060
	4.85% AUSTRIA GOVERNMENT BOND 20260315	31,000.000	40,394.240
	3.5% FINNISH GOVERNMENT BOND 20210415	51,000.000	58,729.560
	6% SPANISH GOVERNMENT BOND 20290131	21,000.000	26,924.100
	4.1% SPANISH GOVERNMENT BOND 20180730	78,000.000	86,611.200
	4.25% SPANISH GOVERNMENT BOND 20161031	37,000.000	40,046.210
ユーロ	小計		ユーロ 835,700.230 (118,402,009)
国債証券	合計		247,214,902 [247,214,902]
合計			247,214,902 [247,214,902]

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における () 内の金額は、邦貨換算額であります。
2. 合計欄における [] 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 10銘柄	100%	36.4%
イギリス・ポンド	国債証券 3銘柄	100%	6.6%
オーストラリア・ドル	国債証券 2銘柄	100%	4.7%
カナダ・ドル	国債証券 1銘柄	100%	1.3%
シンガポール・ドル	国債証券 1銘柄	100%	0.3%
スイス・フラン	国債証券 1銘柄	100%	0.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券 1銘柄	100%	0.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 1銘柄	100%	0.8%
ノルウェー・クローネ	国債証券 1銘柄	100%	0.2%
ポーランド・ズロチ	国債証券 1銘柄	100%	0.5%
メキシコ・ペソ	国債証券 1銘柄	100%	0.5%
ユーロ	国債証券 14銘柄	100%	48.0%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

[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5月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		46,278,656
コール・ローン		17,261,508
国債証券		2,401,499,486
派生商品評価勘定		568
未収利息		18,689,416
前払費用		11,761,255
流動資産合計		2,495,490,889
資産合計		2,495,490,889
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		36,390
未払金		27,632,516
未払解約金		9,015,000
流動負債合計		36,683,906
負債合計		36,683,906
純資産の部		
元本等		
元本	1	2,324,796,099
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		134,010,884
元本等合計		2,458,806,983
純資産合計		2,458,806,983
負債純資産合計		2,495,490,889

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 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）、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。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 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5月8日現在
1. 1 期首	平成25年10月21日
期首元本額	37,361,150円
期中追加設定元本額	2,349,649,778円
期中一部解約元本額	62,214,829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)	2,202,908,503円
スマート・ミックス(為替ヘッ ジなし)	506,837円
スマート・ミックス・Dガード (為替ヘッジなし)	3,677,981円
りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	57,228,032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)	30,774,746円
計	2,324,796,099円
2. 期末日における受益権の総数	2,324,796,099口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
--------------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成26年5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>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成26年5月8日現在	
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	
国債証券	92,586,980	
合計	92,586,980	

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成25年6月10日から平成26年5月8日まで）を指しております。

（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5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	8,500,000	-	8,499,432	568
アメリカ・ドル	8,500,000	-	8,499,432	568
買 建	5,129,390	-	5,093,000	36,390
アメリカ・ドル	5,129,390	-	5,093,000	36,390
合計	13,629,390	-	13,592,432	35,822

(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5月8日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0576円 (10,576円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル		アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
		11.375% Mexico Government International Bond 20160915	4,000.000	5,005.000	
		6.05% Mexico Government International Bond 20400111	212,000.000	251,220.000	
		8.125% Mexico Government International Bond 20191230	3,000.000	4,038.750	
		8.3% Mexico Government International Bond 20310815	246,000.000	355,470.000	
		7.5% Mexico Government International Bond 20330408	182,000.000	245,245.000	
		6.75% Mexico Government International Bond 20340927	336,000.000	428,400.000	
		5.625% Mexico Government International Bond 20170115	92,000.000	102,442.000	
		5.95% Mexico Government International Bond 20190319	162,000.000	188,973.000	
		5.125% Mexico Government International Bond 20200115	382,000.000	427,744.500	
		3.625% Mexico Government International Bond 20220315	210,000.000	215,145.000	
		4.75% Mexico Government International Bond 20440308	114,000.000	113,715.000	
		4% Mexico Government International Bond 20231002	400,000.000	413,500.000	
		8.875% Panama Government International Bond 20270930	131,000.000	185,692.500	
		9.375% Panama Government International Bond 20290401	154,000.000	224,647.500	

6.7% Panama Government International Bond 20360126	62,000.000	76,012.000	
7.125% Panama Government International Bond 20260129	100,000.000	126,375.000	
8.875% FED REPUBLIC OF BRAZIL 20191014	201,000.000	264,315.000	
8.875% FED REPUBLIC OF BRAZIL 20240415	157,000.000	218,230.000	
8.75% FED REPUBLIC OF BRAZIL 20250204	73,000.000	101,652.500	
10.125% FED REPUBLIC OF BRAZIL 20270515	123,000.000	193,417.500	
12.25% FED REPUBLIC OF BRAZIL 20300306	3,000.000	5,325.000	
8.25% FED REPUBLIC OF BRAZIL 20340120	209,000.000	290,771.250	
7.125% FED REPUBLIC OF BRAZIL 20370120	139,000.000	176,182.500	
6% FED REPUBLIC OF BRAZIL 20170117	100,000.000	111,550.000	
4.875% FED REPUBLIC OF BRAZIL 20210122	200,000.000	218,750.000	
2.625% FED REPUBLIC OF BRAZIL 20230105	200,000.000	183,750.000	
4.25% FED REPUBLIC OF BRAZIL 20250107	600,000.000	603,150.000	
8.75% Argentine Republic International Bond 20170602	469,000.000	444,377.500	
FR 2.5% Argentine Republic International Bond 20381231	532,000.000	232,218.000	
7.75% Venezuela Government International Bond 20191013	207,000.000	172,845.000	
12.75% Venezuela Government International Bond 20220823	5,000.000	5,025.000	
9% Venezuela Government International Bond 20230507	220,000.000	182,600.000	
8.25% Venezuela Government International Bond 20241013	205,000.000	159,900.000	
11.75% Venezuela Government International Bond 20261021	405,000.000	380,700.000	
9.25% Venezuela Government International Bond 20280507	155,000.000	123,225.000	
11.95% Venezuela Government International Bond 20310805	212,000.000	198,220.000	
5.75% Venezuela Government International Bond 20160226	6,000.000	5,565.000	
6% Venezuela Government International Bond 20201209	354,000.000	261,960.000	
7% Venezuela Government International Bond 20380331	5,000.000	3,400.000	
7% Venezuela Government International Bond 20181201	4,000.000	3,356.000	
7.65% Venezuela Government International Bond 20250421	306,000.000	226,440.000	
9.25% Venezuela Government International Bond 20270915	253,000.000	211,255.000	
9.375% Venezuela Government International Bond 20340113	200,000.000	161,000.000	
11.75% REPUBLIC OF COLOMBIA 20200225	22,000.000	32,037.500	
8.125% REPUBLIC OF COLOMBIA 20240521	35,000.000	46,725.000	
7.375% REPUBLIC OF COLOMBIA 20170127	100,000.000	115,600.000	

6.125% REPUBLIC OF COLOMBIA 20410118	200,000.000	234,500.000	
4.375% REPUBLIC OF COLOMBIA 20210712	200,000.000	213,300.000	
2.625% REPUBLIC OF COLOMBIA 20230315	200,000.000	184,700.000	
4% REPUBLIC OF COLOMBIA 20240226	400,000.000	407,600.000	
7.125% Peruvian Government International Bond 20190330	80,000.000	98,000.000	
8.75% Peruvian Government International Bond 20331121	203,000.000	311,605.000	
6.55% Peruvian Government International Bond 20370314	115,000.000	145,475.000	
7.35% Peruvian Government International Bond 20250721	200,000.000	266,000.000	
6.75% Ukraine Government International Bond 20171114	300,000.000	252,000.000	
7.75% Ukraine Government International Bond 20200923	400,000.000	336,000.000	
9.25% Ukraine Government International Bond 20170724	200,000.000	180,000.000	
6.75% Romanian Government International Bond 20220207	92,000.000	110,285.000	
4.375% Romanian Government International Bond 20230822	118,000.000	121,245.000	
6.25% Hungary Government International Bond 20200129	107,000.000	119,626.000	
6.375% Hungary Government International Bond 20210329	232,000.000	261,000.000	
7.625% Hungary Government International Bond 20410329	122,000.000	150,060.000	
4.125% Hungary Government International Bond 20180219	12,000.000	12,456.000	
5.375% Hungary Government International Bond 20230221	224,000.000	237,720.000	
5.75% Hungary Government International Bond 20231122	150,000.000	162,375.000	
6.75% Croatia Government International Bond 20191105	200,000.000	221,750.000	
6.625% Croatia Government International Bond 20200714	300,000.000	330,750.000	
11% Russian Foreign Bond - Eurobond 20180724	145,000.000	186,716.500	
12.75% Russian Foreign Bond - Eurobond 20280624	150,000.000	244,500.000	
FR 7.5% Russian Foreign Bond - Eurobond 20300331	832,960.000	946,034.290	
5% Russian Foreign Bond - Eurobond 20200429	500,000.000	511,250.000	
3.25% Russian Foreign Bond - Eurobond 20170404	200,000.000	203,000.000	
4.5% Russian Foreign Bond - Eurobond 20220404	400,000.000	394,000.000	
5.625% Russian Foreign Bond - Eurobond 20420404	200,000.000	195,000.000	
4.875% Russian Foreign Bond - Eurobond 20230916	200,000.000	197,500.000	
5.875% Russian Foreign Bond - Eurobond 20430916	200,000.000	199,000.000	
9.875% Philippine Government International Bond 20190115	3,000.000	3,997.500	
10.625% Philippine Government International Bond 20250316	16,000.000	25,160.000	

9.5% Philippine Government International Bond 20300202	278,000.000	440,630.000	
6.5% Philippine Government International Bond 20200120	200,000.000	239,750.000	
4% Philippine Government International Bond 20210115	300,000.000	318,000.000	
7.75% Philippine Government International Bond 20310114	200,000.000	281,250.000	
6.375% Philippine Government International Bond 20341023	200,000.000	255,000.000	
5.5% Philippine Government International Bond 20260330	200,000.000	230,000.000	
11.625% Indonesia Government International Bond 20190304	100,000.000	137,000.000	
6.875% Indonesia Government International Bond 20170309	100,000.000	113,250.000	
6.875% Indonesia Government International Bond 20180117	200,000.000	229,750.000	
5.875% Indonesia Government International Bond 20200313	200,000.000	223,250.000	
8.5% Indonesia Government International Bond 20351012	200,000.000	266,000.000	
6.625% Indonesia Government International Bond 20370217	200,000.000	226,000.000	
7.75% Indonesia Government International Bond 20380117	100,000.000	125,250.000	
4.875% Indonesia Government International Bond 20210505	200,000.000	211,500.000	
3.75% Indonesia Government International Bond 20220425	200,000.000	194,500.000	
5.25% Indonesia Government International Bond 20420117	200,000.000	192,500.000	
7% Turkey Government International Bond 20200605	90,000.000	105,075.000	
7.375% Turkey Government International Bond 20250205	212,000.000	257,951.000	
11.875% Turkey Government International Bond 20300115	8,000.000	13,742.400	
8% Turkey Government International Bond 20340214	72,000.000	95,220.000	
6.875% Turkey Government International Bond 20360317	206,000.000	244,882.500	
7.25% Turkey Government International Bond 20380305	152,000.000	189,430.000	
7.5% Turkey Government International Bond 20170714	100,000.000	114,500.000	
6.75% Turkey Government International Bond 20180403	300,000.000	338,850.000	
7% Turkey Government International Bond 20190311	200,000.000	230,500.000	
7.5% Turkey Government International Bond 20191107	200,000.000	236,800.000	
5.625% Turkey Government International Bond 20210330	100,000.000	109,250.000	
6.75% Turkey Government International Bond 20400530	100,000.000	117,250.000	
5.125% Turkey Government International Bond 20220325	200,000.000	210,600.000	
6.25% Turkey Government International Bond 20220926	200,000.000	226,500.000	
6% Turkey Government International Bond 20410114	200,000.000	215,050.000	
3.25% Turkey Government International Bond 20230323	200,000.000	183,550.000	

	4.875% Turkey Government International Bond 20430416	200,000.000	188,250.000	
	5.5% South Africa Government International 20200309	200,000.000	221,000.000	
	5.875% South Africa Government International 20220530	200,000.000	225,040.000	
	4.665% South Africa Government International 20240117	200,000.000	205,000.000	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 23,571,844.190 (2,401,499,486)	
国債証券	合計		2,401,499,486 [2,401,499,486]	
合計			2,401,499,486 [2,401,499,486]	

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
 2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	国債証券 114銘柄	100%	100%

第2 信用取引契約残高明細表
 該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
 「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

[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5月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		60,547,620
国債証券		86,064,480
派生商品評価勘定		32,265
未収利息		24,453
前払金		4,910,400
前払費用		7,293
差入委託証拠金		4,912,500
流動資産合計		156,499,011
資産合計		156,499,011
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		4,549,003
流動負債合計		4,549,003
負債合計		4,549,003
純資産の部		
元本等		
元本	1	143,651,421
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,298,587
元本等合計		151,950,008
純資産合計		151,950,008
負債純資産合計		156,499,011

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 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。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	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。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成26年5月8日現在
1. 1期首 期首元本額	平成25年10月21日 25,492,742円

期中追加設定元本額	154,451,838円
期中一部解約元本額	36,293,159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)	16,893,079円
スマート・ミックス(為替ヘッ ジなし)	471,164円
スマート・ミックス・Dガード (為替ヘッジなし)	3,569,355円
スマート・アロケーション・D ガード	1,154,282円
りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	56,527,439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)	1,471,277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)	23,018,060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)	30,646,765円
計	143,651,421円
2. 期末日における受益権の総数	143,651,421口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における株価指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成26年5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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成26年5月8日現在	
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	
国債証券		8,550
合計		8,550

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成25年6月10日から平成26年5月8日まで）を指しております。

（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5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				
株価指数 先物取引				
買 建	157,506,650	-	153,054,000	4,452,650
合計	157,506,650	-	153,054,000	4,452,650

（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。

- 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。
- 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
- 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5月8日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.0578円 (10,578円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	3 1 8 2年国債	5,000,000	5,000,350	
	3 2 0 2年国債	5,000,000	5,000,650	
	3 2 2 2年国債	16,000,000	16,003,200	
	3 2 3 2年国債	16,000,000	16,003,680	
	3 2 4 2年国債	21,000,000	21,005,670	
	3 2 7 2年国債	10,000,000	10,002,700	
	8 8 5年国債	13,000,000	13,048,230	
国債証券 合計			86,064,480	
合計			86,064,480	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

[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5月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		511,855
コール・ローン		6,845,573
投資信託受益証券		51,875,452
投資証券		42,500,588
派生商品評価勘定		17,969
未収配当金		141,303
差入委託証拠金		2,563,887
流動資産合計		104,456,627
資産合計		104,456,627
負債の部		
流動負債		
未払解約金		17,000
流動負債合計		17,000
負債合計		17,000
純資産の部		
元本等		
元本	1	86,293,595
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		18,146,032
元本等合計		104,439,627
純資産合計		104,439,627
負債純資産合計		104,456,627

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5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	(1)先物取引

	<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</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5月8日現在	
1. 1 期首	平成25年10月21日	
期首元本額	17,120,857円	
期中追加設定元本額	99,261,138円	
期中一部解約元本額	30,088,400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	9,900,000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（為替ヘッ	437,724円	
ジなし）		
スマート・ミックス・Dガード	3,166,571円	
（為替ヘッジなし）		
りそな ダイナミック・アロ	46,218,037円	
ケーション・ファンド		
ダイワ6資産バランス・ファン	26,571,263円	
ド（Dガード付/為替ヘッジな		
し）		
計	86,293,595円	
2. 期末日における受益権の総数	86,293,595口	

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
-----	------------------------------

1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従って外国の取引所における株価指数先物取引を利用しております。また、信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成26年5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。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成26年5月8日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
投資信託受益証券		1,494,287
投資証券		1,287,417
合計		2,781,704

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成25年6月10日から平成26年5月8日まで）を指しております。

（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5月8日 現在		
	契約額等	時価	評価損益

	(円)	うち 1年超	(円)	(円)
市場取引				
株価指数 先物取引				
買 建	9,535,968	-	9,547,430	11,462
合計	9,535,968	-	9,547,430	11,462

(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。

- 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。
- 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。
- 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5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				
買 建	7,021,143	-	7,027,650	6,507
アメリカ・ドル	7,021,143	-	7,027,650	6,507
合計	7,021,143	-	7,027,650	6,507

(注) 1. 時価の算定方法

- 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。

- 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。

- 換算において円未満の端数は切り捨てております。
- 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5月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2103円 (12,103円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカ・ドル	SPDR S&P 500 ETF TRUST	2,710.000	アメリカ・ドル 509,181.900	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 509,181.900 (51,875,452)	
投資信託受益証券 合計				51,875,452 [51,875,452]	
投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI PACIFIC EX J	1,140	アメリカ・ドル 56,122.200	
		ISHARES MSCI CANADA ETF	1,520	46,542.400	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 102,664.600 (10,459,469)	
	ユーロ	ISHARES MSCI EUROPE UCITS	10,665	ユーロ 226,151.320	
	ユーロ	小計		ユーロ 226,151.320 (32,041,119)	
投資証券 合計				42,500,588 [42,500,588]	
合計				94,376,040 [94,376,040]	

投資信託受益証券及び投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における () 内の金額は、邦貨換算額であります。
 2. 合計欄における [] 内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資信託 受益証券 時価比率	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資信託 受益証券 投資証券 2銘柄	83.2%	16.8%	66.0%
ユーロ	投資証券 1銘柄	-%	100%	34.0%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

[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5月8日現在	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
預金		2,044,736
コール・ローン		11,484,892
投資証券		73,230,121
派生商品評価勘定		918,290
差入委託証拠金		1,388,421
流動資産合計		89,066,460
資産合計		89,066,460
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		35,662
未払解約金		29,000
流動負債合計		64,662
負債合計		64,662
純資産の部		
元本等		
元本	1	80,990,025
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,011,773
元本等合計		89,001,798
純資産合計		89,001,798
負債純資産合計		89,066,460

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>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</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> <p>(2)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	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。
4. 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5月8日現在
1. 1 期首	平成25年10月21日
期首元本額	17,136,189円
期中追加設定元本額	91,183,241円
期中一部解約元本額	27,329,405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（為替ヘッ ジなし）	485,728円
スマート・ミックス・Dガード （為替ヘッジなし）	3,531,370円
りそな ダイナミック・アロ ケーション・ファンド	37,608,058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）	29,464,869円
計	80,990,025円
2. 期末日における受益権の総数	80,990,025口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従って外国の取引所における株価指数先物取引を利用しております。また、外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用してしております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成26年5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>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成26年5月8日現在	
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）	
投資証券	3,617,922	
合計	3,617,922	

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成25年6月10日から平成26年5月8日まで）を指しております。

（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5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 株価指数 先物取引				

買 建	14,473,582	-	15,387,446	913,864
合計	14,473,582	-	15,387,446	913,864

(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5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				
買 建	10,929,186	-	10,897,950	31,236
アメリカ・ドル	10,929,186	-	10,897,950	31,236
合計	10,929,186	-	10,897,950	31,236

(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5月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0989円 (10,989円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	ISHARES MSCI EMERGING MKT	17,200	アメリカ・ドル 718,788.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 718,788.000 (73,230,121)	
投資証券	合計			73,230,121 [73,230,121]	
合計				73,230,121 [73,230,121]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
 2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 1銘柄	100%	100%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

[次へ](#)

「国内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26年5月8日現在
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		2,961,547
投資証券	2	81,480,490
派生商品評価勘定		47,771
未収配当金		490,425
流動資産合計		84,980,233
資産合計		84,980,233
負債の部		
流動負債		
前受金		55,000
未払金		371,199
流動負債合計		426,199
負債合計		426,199
純資産の部		
元本等		
元本	1	82,904,854
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		1,649,180
元本等合計		84,554,034
純資産合計		84,554,034
負債純資産合計		84,980,233

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	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。
3. 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26年5月8日現在
1. 1期首	平成25年10月21日

期首元本額	20,039,000円
期中追加設定元本額	92,616,802円
期中一部解約元本額	29,750,948円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
国内REIT資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）	19,963,825円
りそなダイナミック・アロケーション・ファンド	62,941,029円
計	82,904,854円
2. 期末日における受益権の総数	82,904,854口
3. 2 差入委託証拠金代用有価証券	先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 投資証券 566,000円

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自平成25年10月21日 至平成26年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資することを目的として、投資信託約款に従ってわが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区分	平成26年5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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成26年5月8日現在	
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	
投資証券		55,358
合計		55,358

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成25年10月21日から平成26年5月8日まで)を指しております。

(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

不動産投信関連

種 類	平成26年5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				
不動産投信 指数先物取引				
買 建	2,929,000	-	2,978,000	49,000
合計	2,929,000	-	2,978,000	49,000

(注) 1. 時価の算定方法

不動産投信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. 不動産投信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5月8日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0199円 (10,199円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	5	1,812,500	
	M I Dリート投資法人	2	465,800	
	森ヒルズリート	14	1,887,200	
	野村不レジデンシャル	2	1,116,000	

産業ファンド	2	1,750,000	
大和ハウスリート	3	1,233,000	
アドバンス・レジデンス	14	3,256,400	
ケネディクスレジデンシャル	2	447,800	
A P I投資法人	3	2,574,000	
G L P投資法人	22	2,279,200	
コンフォリア・レジデンシャル	1	722,000	
日本プロロジスリート	16	3,412,800	
NMF投資法人	17	1,819,000	
S I A不動産投資	1	391,500	
イオンリート投資	10	1,304,000	
ヒューリックリート投資法	7	992,600	
日本ビルファンド	15	8,490,000	
ジャパンリアルエステイト	13	7,098,000	
日本リテールファンド	24	4,922,400	
オリックス不動産投資	20	2,592,000	
日本プライムリアルティ	9	3,235,500	
プレミア投資法人	2	770,000	
東急リアル・エステート	10	1,304,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	2	622,000	
野村不動産オフィスF	4	1,754,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	25	3,870,000	
森トラスト総合リート	14	2,164,400	
インヴィンシブル投資法人	16	288,640	
フロンティア不動産投資	5	2,670,000	
平和不動産リート	9	739,800	
日本ロジスティクスファンド投資法人	9	2,001,600	
福岡リート投資法人	7	1,140,300	
ケネディクス・オフィス投資法人	3	1,539,000	
積水ハウス・S I 投資法人	9	865,800	
いちご不動産投資法人	11	679,800	
大和証券オフィス投資法人	4	2,052,000	
阪急リート投資法人	1	552,000	
スターツプロシード投資法人	1	168,900	
トップリート投資法人	2	896,000	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	4	1,672,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	27	1,224,450	
日本賃貸住宅投資法人	15	946,500	
ジャパンエクセレント投資法人	13	1,757,600	
投資証券 合計		81,480,490	
合計		81,480,490	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

(注) 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。

日本ビルファンド

1口

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

[次へ](#)

「先進国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26年5月8日現在	
	金額(円)	
資産の部		
流動資産		
預金		538,698
コール・ローン		2,817,899
投資証券		161,825,146
未収入金		196
未収配当金		138,524
流動資産合計		165,320,463
資産合計		165,320,463
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	139,034,474
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		26,285,989
元本等合計		165,320,463
純資産合計		165,320,463
負債純資産合計		165,320,463

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 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。

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</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5月8日現在
1. 1 期首	平成25年10月21日
期首元本額	20,674,000円
期中追加設定元本額	141,509,212円
期中一部解約元本額	23,148,738円
期末元本額の内訳	
ファンド名	
先進国REIT（為替ヘッジなし）	19,947,839円
資金拠出用ファンド（適格機関投資家専用）	
スマート・インカム・スイング（部分為替ヘッジあり）	352,389円
スマート・インカム・スイング（為替ヘッジなし）	355,344円
りそな ダイナミック・アロケーション・ファンド	47,686,726円
ダイワ外国3資産アロケーション・ファンド（部分為替ヘッジあり）	70,692,176円
計	139,034,474円
2. 期末日における受益権の総数	139,034,474口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成25年10月21日 至 平成26年5月8日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。
--------------------------------	--

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成26年5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。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成26年5月8日現在	
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	
投資証券		11,608,681
合計		11,608,681

(注)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成25年9月9日から平成26年5月8日まで)を指しております。

(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5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5月8日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1891円 (11,891円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種 類	通 貨	銘 柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	300	41,733.000	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	700	123,011.000	
		BOSTON PROPERTIES INC	400	47,480.000	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	500	15,895.000	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	1,500	35,115.000	
		VORNADO REALTY TRUST	500	52,600.000	
		EQUITY RESIDENTIAL	800	49,232.000	
		HOST HOTELS&RESORTS INC	2,000	42,760.000	
		RLJ LODGING TRUST	600	15,966.000	
		KIMCO REALTY CORP	1,400	32,480.000	

	VENTAS INC	700	47,516.000	
	AMERICAN REALTY CAP PROP	1,500	19,395.000	
	PROLOGIS INC	1,200	49,464.000	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ	300	22,431.000	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	200	14,214.000	
	DDR CORP	1,500	25,935.000	
	DUKE REALTY CORP	1,200	21,048.000	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	159	28,557.990	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	300	35,913.000	
	HEALTH CARE REIT INC	600	38,178.000	
	HCP INC	1,100	46,706.000	
	KILROY REALTY CORP	400	24,244.000	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	400	15,160.000	
	MACERICH CO/THE	500	32,715.000	
	REALTY INCOME CORP	600	26,526.000	
	PUBLIC STORAGE	300	51,960.000	
	REGENCY CENTERS CORP	400	21,388.000	
	SL GREEN REALTY CORP	300	32,277.000	
	UDR INC	800	21,440.000	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	300	16,737.000	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	400	20,788.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 1,068,864.990 (108,895,965)
イギリス・ポンド				イギリス・ポンド
	LAND SECURITIES PLC	2,030	21,883.400	
	SEGRO PLC	3,010	10,685.500	
	HAMMERSON PLC	2,580	15,028.500	
	BRITISH LAND CO PLC	2,710	18,902.250	
イギリス・ポンド	小計			イギリス・ポンド 66,499.650 (11,485,820)
オーストラリア・ドル				オーストラリア・ドル
	WESTFIELD RETAIL TRUST	8,800	28,072.000	
	GPT GROUP	5,600	21,840.000	
	MIRVAC GROUP	11,100	19,314.000	
	STOCKLAND	5,700	21,888.000	
	WESTFIELD GROUP	4,500	47,835.000	
	GOODMAN GROUP	4,700	23,406.000	
オーストラリア・ドル	小計			オーストラリア・ドル 162,355.000 (15,428,596)
カナダ・ドル				カナダ・ドル
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-	1,200	27,900.000	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST	1,000	27,290.000	
カナダ・ドル	小計			カナダ・ドル 55,190.000 (5,157,506)
シンガポール・ドル				シンガポール・ドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV	10,000	23,600.000	
	CAPITAMALL TRUST	16,000	32,320.000	
	SUNTEC REIT	13,000	22,685.000	
シンガポール・ドル	小計			シンガポール・ドル 78,605.000 (6,408,666)
ユーロ				ユーロ
	UNIBAIL-RODAMCO SE	230	45,609.000	
	KLEPIERRE	510	17,110.500	

	COFINIMMO	200	18,004.000	
ユーロ	小計		ユーロ 80,723.500 (11,436,905)	
香港・ドル	LINK REIT	6,000	香港・ドル 229,200.000	
香港・ドル	小計		香港・ドル 229,200.000 (3,011,688)	
投資証券	合計		161,825,146 [161,825,146]	
合計			161,825,146 [161,825,146]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (注) 1. 各種通貨毎の小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。
 2. 合計欄における[]内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。
 3. 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	投資証券 31銘柄	100%	67.2%
イギリス・ポンド	投資証券 4銘柄	100%	7.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 6銘柄	100%	9.5%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	100%	3.2%
シンガポール・ドル	投資証券 3銘柄	100%	4.0%
ユーロ	投資証券 3銘柄	100%	7.1%
香港・ドル	投資証券 1銘柄	100%	1.9%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

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5月30日

資産総額	913,666,970円
負債総額	1,210,014円
純資産総額（ - ）	912,456,956円
発行済数量	893,013,831口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0218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5月30日

資産総額	537,048,275円
負債総額	1,147,540円
純資産総額（ - ）	535,900,735円
発行済数量	523,723,558口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0233円

(参考) 先進国債券（為替ヘッジあり）マザーファンド

純資産額計算書

平成26年5月30日

資産総額	262,522,591円
負債総額	57,236円
純資産総額（ - ）	262,465,355円
発行済数量	251,338,963口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0443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5月30日

資産総額	2,489,051,029円
負債総額	46,890円

純資産総額（ - ）	2,489,004,139円
発行済数量	2,312,349,215口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0764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5月30日

資産総額	152,990,171円
負債総額	802,567円
純資産総額（ - ）	152,187,604円
発行済数量	138,835,855口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0962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5月30日

資産総額	99,212,752円
負債総額	8,673円
純資産総額（ - ）	99,204,079円
発行済数量	80,645,944口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2301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5月30日

資産総額	85,648,180円
負債総額	6,223円
純資産総額（ - ）	85,641,957円
発行済数量	75,638,106口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1323円

(参考) 国内REITマザーファンド

純資産額計算書

平成26年5月30日

資産総額	76,679,628円
負債総額	549,356円
純資産総額（ - ）	76,130,272円
発行済数量	71,087,795口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0709円

(参考) 先進国REITマザーファンド

純資産額計算書

平成26年5月30日

資産総額	168,130,537円
負債総額	1,946,332円
純資産総額（ - ）	166,184,205円
発行済数量	139,019,614口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.1954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5月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

イ. ファンド個別会議

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

ロ. 投資環境検討会

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

ハ. 運用会議

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

ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

ホ．ファンド評価会議、運用審査会議およびオペレーショナルリスク・監査会議

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

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

2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成26年5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	12	163,571
追加型株式投資信託	518	9,785,257
株式投資信託 合計	530	9,948,828
単位型公社債投資信託	-	-
追加型公社債投資信託	17	3,116,016
公社債投資信託 合計	17	3,116,016
総合計	547	13,064,844

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。

なお、当事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則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、当事業年度（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。

3. 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)
負債の部		
流動負債		
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
固定負債		
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 (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。

<注1>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。

<注2>時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	前事業年度 (平成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。

<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的主要原因別内訳

（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。

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。

第2 【その他の関係法人の概況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第2 その他の関係法人の概況」を次の内容に訂正・更新します。

< 訂正後 >

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成26年3月末日現在）

事業の内容

銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位：百万円 （平成26年3月 末日現在）	事業の内容
株式会社近畿大阪銀行	38,971	銀行法に基づき銀行業 を営んでいます。 (注)
株式会社埼玉りそな銀行	70,000	
株式会社りそな銀行	279,928	

(注) 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行いません。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行いません。

3 【資本関係】

該当事項はありません。

< 再信託受託会社の概要 >

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（平成26年3月末日現在）

事業の内容：銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

再信託の目的：原信託契約にかかる信託事務の一部（信託財産の管理）を原信託受託会社から再信託受託会社へ委託するため、原信託財産のすべてを再信託受託会社へ移管することを目的とします。

独立監査人の監査報告書

平成26年6月6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」に掲げられているりそな ダイナミック・アロケーション・ファンドの平成25年10月21日から平成26年5月8日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、りそな ダイナミック・アロケーション・ファンドの平成26年5月8日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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）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。