

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 平成28年8月3日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 岩本 信之

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

【電話番号】 03-5555-3111

【届出の対象とした募集内  
国投資信託受益証券に係る  
ファンドの名称】 安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)  
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)  
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)  
(総称を「ダイワ・マルチアセット・ファンド・シリーズ  
(愛称：ミルフィーユ)(奇数月分配型)」とします。)

【届出の対象とした募集内  
国投資信託受益証券の金  
額】 継続申込期間（平成28年2月4日から平成29年2月3日まで）  
各ファンドについて、3兆円を上限とし、合計で9兆円を上限と  
します。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年2月3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】

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

## 第二部 【ファンド情報】

### 第1 【ファンドの状況】

#### 1 【ファンドの性格】

##### (3) 【ファンドの仕組み】

<更新後>

<略>

<委託会社の概況（平成28年5月末日現在）>

<略>

#### 2 【投資方針】

##### (3) 【運用体制】

<更新後>

<略>

職務権限

<略>

ロ . Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ . インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

CIOおよびDeputy-CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

<略>

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は30～40名程度です。

<略>

上記の運用体制は平成28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。

#### 3 【投資リスク】

<更新後>

<略>

## 参 考 情 報

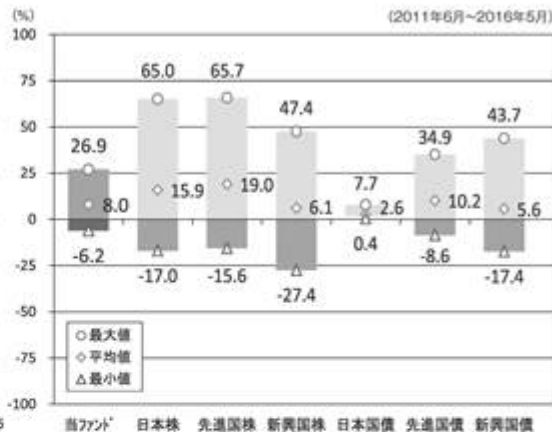
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間に於ける年間騰落率の推移を表示しています。

### ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

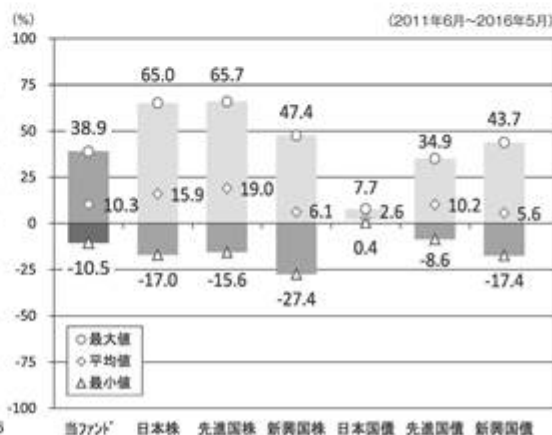
#### [安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)]



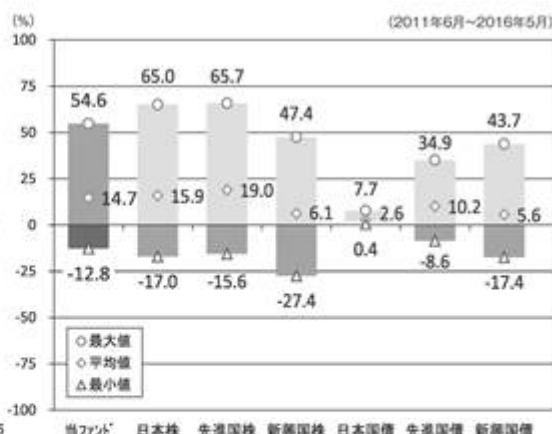
### 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



#### [インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)]



#### [成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)]



※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。

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

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

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

## ※資産クラスについて

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

## ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●シティ世界国債インデックスは、Citigroup Index LLCが開発したインデックスです。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

## 4 【手数料等及び税金】

## (5) 【課税上の取扱い】

## &lt;更新後&gt;

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

<略>

## 八．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

公募株式投資信託は、税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたNISAをご利用の場合、毎年、年間120万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。また、20歳未満の方を対象とした非課税制度「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、年間80万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります（他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。）。

ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方となります。当ファンドの非課税口座における取扱いは販売会社により異なる場合があります。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

< 略 >

( ) 上記は、平成28年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>

## 【安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

## (1) 【投資状況】（平成28年5月31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	1,252,918,754	99.16
内 日本	1,252,918,754	99.16
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,668,594	0.84
純資産総額	1,263,587,348	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】（平成28年5月31日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	271,757,607	1.6003 434,893,707	1.6223 440,872,365	34.89
2	ダイワ日本国債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	344,769,024	1.2645 435,960,441	1.2661 436,512,061	34.55
3	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	55,582,662	2.2154 123,137,830	2.2736 126,372,740	10.00
4	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	31,269,272	1.9956 62,404,086	2.0060 62,726,159	4.96
5	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	24,910,678	2.5124 62,585,588	2.4525 61,093,437	4.83
6	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	20,750,855	1.9345 40,144,604	2.0158 41,829,573	3.31
7	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	29,031,550	1.3664 39,668,710	1.4401 41,808,335	3.31
8	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	23,543,008	1.7121 40,309,401	1.7714 41,704,084	3.30

(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	99.16%

合計	99.16%
----	--------

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第2特定期間末 (平成18年11月10日)	3,073,402,313	3,090,649,361	1.0556	1.0615
第3特定期間末 (平成19年5月10日)	4,995,411,451	5,026,275,763	1.1207	1.1277
第4特定期間末 (平成19年11月12日)	6,053,001,955	6,092,366,621	1.0632	1.0701
第5特定期間末 (平成20年5月12日)	5,595,838,241	5,635,179,981	0.9950	1.0020
第6特定期間末 (平成20年11月10日)	4,210,794,891	4,246,901,969	0.8163	0.8233
第7特定期間末 (平成21年5月11日)	4,078,083,050	4,112,743,901	0.8234	0.8304
第8特定期間末 (平成21年11月10日)	4,188,672,164	4,223,860,620	0.8320	0.8390
第9特定期間末 (平成22年5月10日)	3,987,129,147	4,021,010,092	0.8238	0.8308
第10特定期間末 (平成22年11月10日)	3,709,986,656	3,742,470,859	0.7995	0.8065
第11特定期間末 (平成23年5月10日)	3,340,858,725	3,370,124,274	0.7991	0.8061
第12特定期間末 (平成23年11月10日)	2,810,108,392	2,836,542,685	0.7441	0.7511
第13特定期間末 (平成24年5月10日)	2,560,967,176	2,584,608,951	0.7583	0.7653
第14特定期間末 (平成24年11月12日)	2,292,447,787	2,313,809,883	0.7512	0.7582
第15特定期間末 (平成25年5月10日)	2,142,721,022	2,154,379,012	0.9190	0.9240



第16特定期間末 (平成25年11月11日)	1,828,381,467	1,838,763,868	0.8805	0.8855
第17特定期間末 (平成26年5月12日)	1,599,035,793	1,607,888,426	0.9031	0.9081
第18特定期間末 (平成26年11月10日)	1,564,939,411	1,573,080,464	0.9611	0.9661
第19特定期間末 (平成27年5月11日)	1,466,139,398	1,473,605,263	0.9819	0.9869
平成27年5月末日	1,458,070,701	-	0.9943	-
6月末日	1,419,080,161	-	0.9782	-
7月末日	1,393,305,562	-	0.9789	-
8月末日	1,348,634,272	-	0.9530	-
9月末日	1,319,603,968	-	0.9346	-
10月末日	1,342,576,868	-	0.9536	-
第20特定期間末 (平成27年11月10日)	1,332,286,357	1,339,328,742	0.9459	0.9509
11月末日	1,337,379,862	-	0.9514	-
12月末日	1,319,022,454	-	0.9437	-
平成28年1月末日	1,298,792,020	-	0.9291	-
2月末日	1,282,480,355	-	0.9044	-
3月末日	1,309,415,806	-	0.9211	-
4月末日	1,289,026,020	-	0.9095	-
第21特定期間末 (平成28年5月10日)	1,275,810,635	1,280,763,009	0.9017	0.9052
5月末日	1,263,587,348	-	0.9109	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第2特定期間	0.0180
第3特定期間	0.0190
第4特定期間	0.0210
第5特定期間	0.0210
第6特定期間	0.0210
第7特定期間	0.0210
第8特定期間	0.0210
第9特定期間	0.0210
第10特定期間	0.0210
第11特定期間	0.0210
第12特定期間	0.0210
第13特定期間	0.0210
第14特定期間	0.0210
第15特定期間	0.0170
第16特定期間	0.0150
第17特定期間	0.0150
第18特定期間	0.0150
第19特定期間	0.0150
第20特定期間	0.0150

第21特定期間	0.0135
---------	--------

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

#### 【収益率の推移】

	収益率(%)
第2特定期間	5.1
第3特定期間	8.0
第4特定期間	3.3
第5特定期間	4.4
第6特定期間	15.8
第7特定期間	3.4
第8特定期間	3.6
第9特定期間	1.5
第10特定期間	0.4
第11特定期間	2.6
第12特定期間	4.3
第13特定期間	4.7
第14特定期間	1.8
第15特定期間	24.6
第16特定期間	2.6
第17特定期間	4.3
第18特定期間	8.1
第19特定期間	3.7
第20特定期間	2.1
第21特定期間	3.2

#### (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第2特定期間	2,485,711,689	41,842,503
第3特定期間	2,085,303,392	539,715,156
第4特定期間	1,534,637,676	298,662,544
第5特定期間	294,023,666	363,383,984
第6特定期間	111,742,716	577,380,392
第7特定期間	32,560,536	238,087,873
第8特定期間	197,820,936	115,863,494
第9特定期間	164,875,064	359,366,499
第10特定期間	52,988,997	252,523,700
第11特定期間	48,215,226	508,022,904
第12特定期間	34,639,493	439,104,672
第13特定期間	25,669,129	424,600,240
第14特定期間	17,944,954	343,613,359
第15特定期間	29,124,357	749,254,227
第16特定期間	67,499,016	322,616,895
第17特定期間	20,512,498	326,466,069
第18特定期間	36,554,030	178,870,138
第19特定期間	30,337,306	165,374,860
第20特定期間	28,106,161	112,802,115
第21特定期間	74,111,919	67,624,842

(参考) マザーファンド  
 ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資状況（平成28年5月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	36,064,577,817	90.72
内 ユーロ	9,716,537,381	24.44
内 ノルウェー	434,842,037	1.09
内 スウェーデン	866,211,527	2.18
内 デンマーク	766,113,692	1.93
内 イギリス	4,297,590,340	10.81
内 ポーランド	3,049,145,724	7.67
内 カナダ	3,001,500,406	7.55
内 アメリカ	9,316,656,886	23.43
内 オーストラリア	4,615,979,824	11.61
特殊債券	1,880,102,588	4.73
内 カナダ	1,880,102,588	4.73
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,811,128,487	4.56
純資産総額	39,755,808,892	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(%)
債券先物取引(買建)	1,370,338,760	3.45
内 ドイツ	1,370,338,760	3.45
為替予約取引(買建)	2,738,522,130	6.89
内 日本	2,738,522,130	6.89
為替予約取引(売建)	2,816,442,029	7.08
内 日本	2,816,442,029	7.08

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

(注2) 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) 債券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28年5月31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	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	26,500,000	104.11 3,411,627,768	103.62 3,395,604,583	0.800000 2025/06/22	8.54
2	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	26,000,000	99.01 2,856,099,197	97.89 2,823,578,316	1.625000 2026/02/15	7.10
3	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	15,800,000	140.57 2,746,449,749	139.82 2,731,797,224	5.400000 2025/03/13	6.87
4	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	25,000,000	118.06 2,355,927,210	118.63 2,367,321,515	5.750000 2021/05/15	5.95
5	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	10,500,000	131.52 2,246,821,920	130.32 2,226,321,720	5.000000 2025/03/07	5.60
6	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	55,000,000	117.85 1,823,316,275	116.94 1,809,237,210	5.750000 2021/10/25	4.55
7	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	17,000,000	123.85 1,680,651,606	124.33 1,687,164,918	4.500000 2033/04/21	4.24
8	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	15,000,000	99.88 1,662,149,883	99.90 1,662,535,746	1.375000 2021/04/30	4.18
9	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	8,000,000	104.72 1,363,035,520	104.81 1,364,206,960	2.000000 2020/07/22	3.43
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,000,000	104.71 1,277,818,014	103.46 1,262,563,764	2.250000 2025/11/15	3.18
11	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	39,000,000	113.83 1,248,794,781	113.02 1,239,908,514	5.250000 2020/10/25	3.12
12	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	13,000,000	108.80 1,202,861,036	108.59 1,200,561,554	2.250000 2025/06/01	3.02
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	11,000,000	98.82 1,205,939,988	96.87 1,182,204,375	2.500000 2046/02/15	2.97
14	Slovenia Government Bond	ユーロ	国債証券	8,000,000	119.46 1,181,727,996	119.14 1,178,612,016	4.375000 2021/01/18	2.96
15	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	8,000,000	102.17 1,010,734,884	102.02 1,009,211,516	1.000000 2026/05/15	2.54
16	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	110.15 977,603,280	110.00 976,272,000	5.125000 2020/01/15	2.46
17	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	10,000,000	111.04 944,360,696	110.61 940,652,952	2.750000 2022/06/01	2.37
18	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	41,000,000	113.07 770,513,005	112.42 766,113,691	1.750000 2025/11/15	1.93
19	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,000,000	144.90 707,256,900	144.86 707,061,660	4.250000 2046/12/07	1.78
20	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	8,000,000	101.64 691,504,460	101.37 689,674,400	1.500000 2026/06/01	1.73
21	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	7,000,000	103.37 615,346,888	103.51 616,180,280	2.250000 2025/12/15	1.55
22	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,500,000	145.35 629,073,084	141.76 613,501,840	3.250000 2045/05/25	1.54
23	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	6,500,000	107.23 556,377,727	108.22 561,493,390	3.250000 2025/04/21	1.41
24	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	5,000,000	100.02 554,851,676	99.89 554,112,018	0.750000 2017/10/31	1.39
25	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	4,500,000	103.65 517,463,595	102.74 512,918,886	2.000000 2021/11/15	1.29

26	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	35,000,000	108.80 507,625,062	108.21 504,877,082	1.500000 2023/11/13	1.27
27	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	3,000,000	136.17 505,131,128	135.32 501,996,935	1.850000 2027/07/25	1.26
28	Japan Bank For International Cooperation	カナダ	特殊債券	5,000,000	101.61 432,045,720	101.44 431,361,148	2.300000 2018/03/19	1.09
29	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	5,000,000	100.16 425,910,084	99.97 425,106,456	1.250000 2021/06/15	1.07
30	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	4,500,000	106.34 406,976,353	106.47 407,454,703	2.550000 2025/03/15	1.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### 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	90.72%
特殊債券	4.73%
合計	95.44%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
債券先物取引	ドイツ	OAT 10YR 2016年6月	買建	70	1,375,964,835	1,370,338,760	3.45%
為替予約取引	日本	英ポンド買/円売 2016年6月	買建	7,000,000	1,126,424,063	1,138,830,000	2.86%
		カナダ・ドル買/円売 2016年6月	買建	9,436,378	792,400,000	802,092,130	2.02%
		豪ドル買/円売 2016年6月	買建	10,000,000	802,616,024	797,600,000	2.01%
		ポーランド・ズロチ売/円 買 2016年6月	売建	12,757,789	354,283,800	358,749,026	0.90%
		ユーロ売/円買 2016年6月	売建	4,866,122	595,516,065	601,647,379	1.51%
		カナダ・ドル売/円買 2016年6月	売建	11,538,019	979,240,222	980,794,624	2.47%
		米ドル売/円買 2016年6月	売建	700,000	76,842,850	77,651,000	0.20%
		豪ドル売/円買 2016年6月	売建	10,000,000	792,400,000	797,600,000	2.01%

(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) 債券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。

## ダイワ日本国債マザーファンド

## (1) 投資状況（平成28年5月31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		418,799,690,610	99.13
	内 日本	418,799,690,610	99.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,671,823,202	0.87
純資産総額		422,471,513,812	100.00

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

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

## (2) 投資資産（平成28年5月31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	43 20年国債	日本	国債証券	14,172,000,000	110.87 15,712,921,560	110.43 15,650,139,600	2.900000 2019/09/20	3.70
2	4 30年国債	日本	国債証券	10,100,000,000	139.25 14,064,362,000	141.44 14,286,046,000	2.900000 2030/11/20	3.38
3	40 20年国債	日本	国債証券	11,742,000,000	106.26 12,477,636,300	105.86 12,430,668,300	2.300000 2018/09/20	2.94
4	1 30年国債	日本	国債証券	8,450,000,000	135.29 11,432,512,000	137.42 11,612,497,000	2.800000 2029/09/20	2.75
5	33 利付国債20年	日本	国債証券	11,194,000,000	102.03 11,421,909,840	101.20 11,328,663,820	3.800000 2016/09/20	2.68
6	37利付国債20年	日本	国債証券	10,723,000,000	104.97 11,256,683,710	104.38 11,192,667,400	3.100000 2017/09/20	2.65
7	42 20年国債	日本	国債証券	10,218,000,000	108.41 11,077,844,700	107.99 11,035,133,460	2.600000 2019/03/20	2.61
8	80 20年国債	日本	国債証券	9,023,000,000	120.13 10,839,416,130	120.64 10,885,437,430	2.100000 2025/06/20	2.58
9	88 20年国債	日本	国債証券	8,660,000,000	123.68 10,710,764,600	124.36 10,769,835,800	2.300000 2026/06/20	2.55
10	102 20年国債	日本	国債証券	8,020,000,000	128.10 10,274,261,600	129.62 10,395,604,200	2.400000 2028/06/20	2.46
11	70 20年国債	日本	国債証券	8,288,000,000	120.89 10,019,608,840	121.17 10,042,652,480	2.400000 2024/06/20	2.38
12	34 利付国債20年	日本	国債証券	9,219,000,000	103.71 9,561,485,850	102.98 9,494,002,770	3.500000 2017/03/20	2.25
13	58 20年国債	日本	国債証券	8,325,000,000	113.53 9,451,872,000	113.69 9,464,775,750	1.900000 2022/09/20	2.24
14	38利付国債20年	日本	国債証券	8,726,000,000	105.81 9,233,587,220	105.32 9,190,659,500	2.700000 2018/03/20	2.18

15	97 20年国債	日本	国債証券	7,240,000,000	124.62 9,022,994,800	125.78 9,106,978,800	2.200000 2027/09/20	2.16
16	64 20年国債	日本	国債証券	7,735,000,000	115.46 8,930,903,350	115.77 8,955,118,900	1.900000 2023/09/20	2.12
17	47 20年国債	日本	国債証券	8,050,000,000	110.80 8,919,641,500	110.56 8,900,321,500	2.200000 2020/09/21	2.11
18	95 20年国債	日本	国債証券	6,905,000,000	125.35 8,655,531,600	126.46 8,732,132,050	2.300000 2027/06/20	2.07
19	106 20年国債	日本	国債証券	6,740,000,000	125.96 8,490,243,200	127.61 8,601,048,800	2.200000 2028/09/20	2.04
20	44 20年国債	日本	国債証券	7,585,000,000	110.77 8,402,283,750	110.45 8,378,163,450	2.500000 2020/03/20	1.98
21	52 20年国債	日本	国債証券	7,368,000,000	112.59 8,295,852,240	112.54 8,292,020,880	2.100000 2021/09/21	1.96
22	54 20年国債	日本	国債証券	6,787,000,000	113.74 7,719,737,410	113.69 7,716,411,780	2.200000 2021/12/20	1.83
23	2 30年国債	日本	国債証券	5,600,000,000	131.46 7,361,874,000	132.92 7,444,024,000	2.400000 2030/02/20	1.76
24	59 20年国債	日本	国債証券	6,495,000,000	112.69 7,319,280,450	112.87 7,331,101,350	1.700000 2022/12/20	1.74
25	65 20年国債	日本	国債証券	6,077,000,000	115.93 7,045,248,410	116.23 7,063,479,410	1.900000 2023/12/20	1.67
26	72 20年国債	日本	国債証券	5,800,000,000	118.85 6,893,542,500	119.21 6,914,412,000	2.100000 2024/09/20	1.64
27	83 20年国債	日本	国債証券	5,650,000,000	120.87 6,829,155,000	121.44 6,861,812,000	2.100000 2025/12/20	1.62
28	48 20年国債	日本	国債証券	6,001,000,000	112.81 6,770,268,190	112.56 6,754,845,620	2.500000 2020/12/21	1.60
29	63 20年国債	日本	国債証券	5,708,000,000	114.24 6,521,100,600	114.54 6,538,228,600	1.800000 2023/06/20	1.55
30	56 20年国債	日本	国債証券	5,370,000,000	113.64 6,102,521,700	113.75 6,108,375,000	2.000000 2022/06/20	1.45

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	99.13%
合計	99.13%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

## (1) 投資状況（平成28年5月31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		135,054,120,157	97.15
	内 香港	4,059,505,523	2.92
	内 シンガポール	6,798,555,820	4.89
	内 イギリス	18,204,654,005	13.10
	内 オランダ	2,943,296,576	2.12
	内 フランス	9,799,248,225	7.05
	内 ドイツ	1,056,691,612	0.76
	内 スペイン	1,806,984,983	1.30
	内 イタリア	1,226,269,420	0.88
	内 カナダ	1,669,250,203	1.20
	内 アメリカ	68,903,372,385	49.56
	内 オーストラリア	18,586,291,405	13.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,963,879,883	2.85
純資産総額		139,018,000,040	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)		110,930,000	0.08
	内 日本	110,930,000	0.08

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

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

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

## (2) 投資資産（平成28年5月31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	401,197	22,094.58 8,864,298,777	21,940.60 8,802,504,423	6.33
2	KLEPIERRE	フランス	投資証券	1,704,158	4,996.69 8,515,160,314	5,145.69 8,769,076,874	6.31
3	HAMMERSON PLC	イギリス	投資証券	7,104,813	942.35 6,695,310,337	957.48 6,802,783,846	4.89
4	VICINITY CENTRES	オーストラリア	投資証券	20,682,112	246.64 5,101,114,696	261.80 5,414,775,470	3.90
5	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	13,127,486	345.62 4,537,129,588	372.75 4,893,393,805	3.52



6	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	アメリカ	投資証券	954,954	4,342.19 4,146,593,237	4,746.01 4,532,224,289	3.26
7	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	435,723	9,682.84 4,219,037,488	10,309.65 4,492,153,457	3.23
8	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	749,474	4,853.51 3,637,616,674	5,278.52 3,956,117,396	2.85
9	DEXUS PROPERTY GROUP	オーストラリア	投資証券	5,180,221	624.83 3,236,850,971	698.42 3,617,995,852	2.60
10	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	4,539,843	677.48 3,075,853,729	713.92 3,241,119,217	2.33
11	LINK REIT	香港	投資証券	4,779,920	638.31 3,051,099,415	673.30 3,218,329,696	2.32
12	BIG YELLOW GROUP PLC	イギリス	投資証券	2,260,211	1,229.84 2,779,836,697	1,361.79 3,077,953,080	2.21
13	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	268,702	10,144.35 2,725,808,101	10,562.59 2,838,191,047	2.04
14	HCP INC	アメリカ	投資証券	655,245	3,619.97 2,371,968,684	3,665.45 2,401,772,765	1.73
15	DDR CORP	アメリカ	投資証券	1,242,404	1,913.71 2,377,607,171	1,913.71 2,377,607,171	1.71
16	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	211,003	10,573.46 2,231,034,448	11,158.34 2,354,444,312	1.69
17	CUBESMART	アメリカ	投資証券	637,214	3,499.04 2,229,642,117	3,522.34 2,244,487,547	1.61
18	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	210,248	9,985.37 2,099,407,952	10,501.58 2,207,936,276	1.59
19	KILROY REALTY CORP	アメリカ	投資証券	291,328	6,349.09 1,849,669,498	6,971.46 2,030,984,296	1.46
20	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	722,619	2,724.68 1,968,928,959	2,797.90 2,021,820,614	1.45
21	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	49,301	34,837.37 1,717,517,612	40,666.16 2,004,882,670	1.44
22	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	77,379	24,529.94 1,898,102,490	25,172.28 1,947,806,318	1.40
23	FORTUNE REIT	シンガポール	投資証券	15,935,070	114.81 1,829,524,509	122.09 1,945,576,437	1.40
24	WERELDHAVE NV	オランダ	投資証券	339,177	5,993.31 2,032,794,771	5,703.97 1,934,656,959	1.39
25	CAPITALAND MALL TRUST	シンガポール	投資証券	11,318,700	169.74 1,921,343,666	164.11 1,857,602,407	1.34
26	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	230,551	7,678.15 1,770,206,867	7,771.34 1,791,691,822	1.29
27	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	207,396	8,241.73 1,709,302,374	8,564.56 1,776,257,145	1.28
28	CAMDEN PROPERTY TRUST	アメリカ	投資証券	187,611	9,243.63 1,734,227,336	9,455.41 1,773,940,089	1.28
29	KEPPEL DC REIT	シンガポール	投資証券	20,389,571	85.67 1,746,963,151	86.48 1,763,366,561	1.27
30	ASSURA PLC	イギリス	投資証券	18,452,853	88.67 1,638,002,879	92.41 1,705,294,575	1.23

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.15%
合計	97.15%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2016年6月	売建	1,000,000	110,721,300	110,930,000	0.08%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンド

### (1) 投資状況（平成28年5月31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	79,639,135,000	97.95
内 日本	79,639,135,000	97.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,663,346,836	2.05
純資産総額	81,302,481,836	100.00

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

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

### (2) 投資資産（平成28年5月31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	10,100	682,000.00 6,888,200,000	659,000.00 6,655,900,000	8.19
2	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	10,000	683,000.00 6,830,000,000	649,000.00 6,490,000,000	7.98

3	日本リテールファンド	日本	投資証券	19,000	270,600.00 5,141,400,000	257,700.00 4,896,300,000	6.02
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	22,391	170,600.00 3,819,904,600	175,000.00 3,918,425,000	4.82
5	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	20,000	186,600.00 3,732,000,000	175,000.00 3,500,000,000	4.30
6	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	30,000	98,800.00 2,964,000,000	96,300.00 2,889,000,000	3.55
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	12,000	257,400.00 3,088,800,000	240,400.00 2,884,800,000	3.55
8	API投資法人	日本	投資証券	4,700	601,000.00 2,824,700,000	566,000.00 2,660,200,000	3.27
9	GLP投資法人	日本	投資証券	20,000	131,900.00 2,638,000,000	127,400.00 2,548,000,000	3.13
10	大和ハウスリート	日本	投資証券	4,200	580,786.31 2,439,302,518	599,000.00 2,515,800,000	3.09
11	森ヒルズリート	日本	投資証券	15,000	167,800.00 2,517,000,000	165,800.00 2,487,000,000	3.06
12	オリックス不動産投資	日本	投資証券	14,000	186,300.00 2,608,200,000	175,300.00 2,454,200,000	3.02
13	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	4,500	489,000.00 2,200,500,000	474,500.00 2,135,250,000	2.63
14	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	3,800	569,000.00 2,162,200,000	542,000.00 2,059,600,000	2.53
15	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	26,000	78,500.00 2,041,000,000	76,300.00 1,983,800,000	2.44
16	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	7,000	291,000.00 2,037,000,000	280,500.00 1,963,500,000	2.42
17	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	3,000	649,000.00 1,947,000,000	630,000.00 1,890,000,000	2.32
18	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,800	698,000.00 1,954,400,000	659,000.00 1,845,200,000	2.27
19	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	6,300	267,031.58 1,682,298,972	272,000.00 1,713,600,000	2.11
20	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	6,800	245,800.00 1,671,440,000	244,400.00 1,661,920,000	2.04
21	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	8,000	193,800.00 1,550,400,000	189,800.00 1,518,400,000	1.87
22	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	16,000	86,400.00 1,382,400,000	86,200.00 1,379,200,000	1.70
23	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	3,000	469,000.00 1,407,000,000	457,000.00 1,371,000,000	1.69
24	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	10,000	131,530.81 1,315,308,151	136,100.00 1,361,000,000	1.67
25	森トラスト総合リート	日本	投資証券	6,000	214,900.00 1,289,400,000	211,400.00 1,268,400,000	1.56
26	インベスコ・オフィス・リート	日本	投資証券	12,500	100,400.00 1,255,000,000	95,700.00 1,196,250,000	1.47
27	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	4,000	292,500.00 1,170,000,000	287,100.00 1,148,400,000	1.41

28	MCUBS MidCity投資法人	日本	投資証券	3,000	378,000.00 1,134,000,000	376,000.00 1,128,000,000	1.39
29	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	10,000	101,909.38 1,019,093,871	103,800.00 1,038,000,000	1.28
30	ケネディクスレジデンシャル	日本	投資証券	3,500	304,500.00 1,065,750,000	295,000.00 1,032,500,000	1.27

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.95%
合計	97.95%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### ダイワ北米好配当株マザーファンド

#### (1) 投資状況 (平成28年5月31日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,452,529,591	72.40
内 カナダ	45,003,678	2.24
内 アメリカ	1,407,525,913	70.16
ハイブリッド優先証券	443,967,935	22.13
内 アメリカ	443,967,935	22.13
投資証券	44,003,751	2.19
内 アメリカ	44,003,751	2.19
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	65,672,118	3.27
純資産総額	2,006,173,395	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)	4,437,200	0.22
内 日本	4,437,200	0.22

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

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

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

(2) 投資資産(平成28年5月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	数 業種 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	5,000	12,405.64 62,028,606	11,132.82 55,664,145	2.77
2	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	9,400	3,631.73 34,138,679	3,839.63 36,092,554	1.80
3	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信 サービス	8,300	4,262.31 35,377,213	4,325.55 35,902,070	1.79
4	BROADCOM LTD	アメリカ	株式	情報技術	2,100	17,619.49 37,000,931	17,007.10 35,714,914	1.78
5	TE CONNECTIVITY LTD	アメリカ	株式	情報技術	5,300	6,984.78 37,019,347	6,616.46 35,067,246	1.75
6	ACCENTURE PLC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	2,500	12,730.36 31,825,913	13,195.20 32,988,009	1.64
7	ALTRIA GROUP INC	アメリカ	株式	生活必需品	4,600	6,849.87 31,509,790	7,095.72 32,640,323	1.63
8	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	390	85,270.48 33,255,524	82,938.74 32,346,110	1.61
9	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	4,200	6,957.38 29,221,041	7,258.80 30,486,978	1.52
10	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	3,034	9,477.60 28,755,051	9,985.70 30,296,642	1.51
11	NEXTERA ENERGY INC	アメリカ	株式	公益事業	2,262	12,885.68 29,147,410	13,295.04 30,073,402	1.50
12	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	4,700	6,262.56 29,434,046	6,265.89 29,449,689	1.47
13	MEDTRONIC PLC	アメリカ	株式	ヘルスケア	3,216	8,583.42 27,604,304	9,062.68 29,145,607	1.45
14	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	5,126	5,417.20 27,769,010	5,641.29 28,917,299	1.44
15	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	3,200	9,090.20 29,088,912	9,033.84 28,908,301	1.44
16	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	2,300	12,185.64 28,026,994	12,542.87 28,848,616	1.44
17	GENERAL DYNAMICS CORP	アメリカ	株式	資本財・ サービス	1,800	15,061.21 27,110,186	15,878.84 28,581,916	1.42
18	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	1,900	14,907.00 28,323,315	14,859.30 28,232,677	1.41
19	HANESBRANDS INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	9,000	3,030.88 27,277,927	2,998.70 26,988,374	1.35
20	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	2,400	10,942.01 26,260,829	11,126.17 26,702,814	1.33

21	CVS HEALTH CORP	アメリカ	株式	生活必需品	2,375	11,217.14 26,640,716	10,754.52 25,541,994	1.27
22	CHUBB LTD	アメリカ	株式	金融	1,800	13,350.51 24,030,935	14,113.78 25,404,816	1.27
23	TIME WARNER INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	3,000	8,308.18 24,924,723	8,351.56 25,054,690	1.25
24	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	4,100	6,141.63 25,180,717	5,804.38 23,797,961	1.19
25	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	アメリカ	株式	金融	2,300	9,461.73 21,762,159	10,011.22 23,025,819	1.15
26	CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	2,000	10,869.90 21,739,802	11,318.09 22,636,198	1.13
27	FORD MOTOR CO	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	14,900	1,452.20 21,637,849	1,492.14 22,232,931	1.11
28	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	6,900	3,139.15 21,660,924	3,208.38 22,137,855	1.10
29	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	3,900	5,690.22 22,192,105	5,615.78 21,901,553	1.09
30	ANTHEM INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,500	15,520.06 23,280,204	14,499.85 21,749,787	1.08

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	72.40%
ハイブリッド優先証券	22.13%
投資証券	2.19%
合計	96.73%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	6.54%
素材	1.54%
資本財・サービス	6.30%
一般消費財・サービス	8.74%
生活必需品	6.23%
ヘルスケア	10.64%
金融	12.86%
情報技術	14.44%
電気通信サービス	2.88%
公益事業	2.23%
合計	72.40%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル売/円買 2016年6月	売建	40,000	4,409,936	4,437,200	0.22%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワ欧州好配当株マザーファンド

## (1) 投資状況 (平成28年5月31日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,289,110,743	93.10
内 ノルウェー	20,494,235	1.48
内 スウェーデン	145,895,915	10.54
内 デンマーク	13,540,984	0.98
内 イギリス	399,961,049	28.88
内 オランダ	118,480,726	8.56
内 フランス	142,094,718	10.26
内 ドイツ	175,168,520	12.65
内 スイス	170,809,075	12.34
内 ポルトガル	20,728,452	1.50
内 スペイン	34,144,649	2.47
内 イタリア	47,792,420	3.45
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	95,607,073	6.90
純資産総額	1,384,717,816	100.00

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

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

## (2) 投資資産 (平成28年5月31日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	数 業種 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必需品	7,685	8,122.48 62,421,320	8,295.90 63,754,007	4.60
2	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	5,611	8,206.39 46,046,099	8,900.05 49,938,203	3.61
3	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	イギリス	株式	生活必需品	7,264	6,849.67 49,756,003	6,842.34 49,702,820	3.59
4	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	電気通信 サービス	21,145	1,929.55 40,800,509	1,978.40 41,833,268	3.02

5	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	52,046	733.77 38,190,158	729.54 37,969,992	2.74
6	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	スウェーデン	株式	生活必需品	10,734	3,441.80 36,944,346	3,511.12 37,688,384	2.72
7	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	15,900	2,443.75 38,855,689	2,363.21 37,575,158	2.71
8	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	5,987	5,645.85 33,801,758	6,217.12 37,221,909	2.69
9	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	4,064	9,558.14 38,844,301	9,138.97 37,140,780	2.68
10	NATIONAL GRID PLC	イギリス	株式	公益事業	22,159	1,630.25 36,124,798	1,641.64 36,377,167	2.63
11	ENAGAS SA	スペイン	株式	公益事業	10,115	3,355.86 33,944,534	3,375.64 34,144,649	2.47
12	TOTAL SA	フランス	株式	エネルギー	6,299	5,294.07 33,347,376	5,411.54 34,087,304	2.46
13	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信サービス	90,005	369.00 33,212,169	378.44 34,061,510	2.46
14	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	14,844	2,299.76 34,137,704	2,268.03 33,666,756	2.43
15	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	4,676	6,750.05 31,563,250	7,195.19 33,644,725	2.43
16	BASF SE	ドイツ	株式	素材	3,829	8,429.22 32,275,485	8,665.39 33,179,786	2.40
17	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	イギリス	株式	エネルギー	11,761	2,957.07 34,778,129	2,725.22 32,051,371	2.31
18	KONINKLIJKE DSM NV	オランダ	株式	素材	4,772	6,342.00 30,264,065	6,648.66 31,727,408	2.29
19	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	イギリス	株式	生活必需品	2,816	11,027.80 31,054,302	11,182.37 31,489,557	2.27
20	SWEDBANK AB - A SHARES	スウェーデン	株式	金融	12,350	2,270.09 28,035,723	2,491.37 30,768,506	2.22
21	KONINKLIJKE PHILIPS NV	オランダ	株式	資本財・サービス	10,209	3,075.79 31,400,778	3,005.31 30,681,242	2.22
22	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,489	11,504.39 28,634,442	12,160.97 30,268,673	2.19
23	AVIVA PLC	イギリス	株式	金融	40,669	727.26 29,577,303	741.42 30,152,968	2.18
24	REXAM PLC	イギリス	株式	素材	29,192	1,012.80 29,565,877	1,020.12 29,779,606	2.15
25	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	138	215,480.88 29,736,361	214,921.48 29,659,164	2.14
26	KONINKLIJKE AHOLD NV	オランダ	株式	生活必需品	11,875	2,476.70 29,410,925	2,481.65 29,469,659	2.13
27	NORDEA BANK AB	スウェーデン	株式	金融	25,741	1,026.10 26,412,957	1,096.39 28,222,239	2.04
28	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,541	18,219.82 28,076,754	18,176.55 28,010,064	2.02
29	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	1,005	23,640.24 23,758,445	27,321.09 27,457,701	1.98



30	KINGFISHER PLC	イギリス	株式	一般消費財・サービス	44,504	599.06 26,660,627	609.47 27,124,039	1.96
----	----------------	------	----	------------	--------	----------------------	----------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.10%
合計	93.10%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	6.42%
素材	8.98%
資本財・サービス	10.28%
一般消費財・サービス	6.93%
生活必需品	15.32%
ヘルスケア	10.10%
金融	21.60%
電気通信サービス	8.38%
公益事業	5.09%
合計	93.10%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

#### ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

#### (1) 投資状況（平成28年5月31日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		922,721,191	90.81
	内 韓国	223,973,646	22.04
	内 中国	92,076,583	9.06
	内 台湾	135,944,750	13.38
	内 香港	25,179,210	2.48
	内 シンガポール	81,493,035	8.02
	内 イギリス	2,304,084	0.23
	内 オーストラリア	361,749,883	35.60
投資信託受益証券		12,440,736	1.22

	内 香港	12,440,736	1.22
投資証券		25,450,607	2.50
	内 オーストラリア	25,450,607	2.50
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		55,532,097	5.46
純資産総額		1,016,144,631	100.00

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

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

## (2) 投資資産（平成28年5月31日現在）

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	数業種は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	123,000	532.18 65,458,792	533.80 65,657,400	6.46
2	AMCOR LIMITED	オーストラリア	株式	素材	39,000	1,202.56 46,902,914	1,310.64 51,115,132	5.03
3	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	韓国	株式	生活必需品	500	91,396.80 45,698,401	96,005.70 48,002,850	4.72
4	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オーストラリア	株式	金融	6,673	5,963.35 39,793,449	6,240.32 41,641,706	4.10
5	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	300	121,290.00 36,387,000	119,424.00 35,827,200	3.53
6	INNOVALUES LTD	シンガポール	株式	一般消費財・サービス	370,000	77.07 28,541,576	78.43 29,022,338	2.86
7	TRANSURBAN GROUP	オーストラリア	株式	資本財・サービス	30,000	889.99 26,699,790	956.24 28,687,308	2.82
8	YESTAR INTERNATIONAL HOLDING	中国	株式	資本財・サービス	579,000	49.12 28,442,333	47.12 27,284,796	2.69
9	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	4,450	5,229.00 23,269,086	5,935.41 26,412,598	2.60
10	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	台湾	株式	金融	189,000	122.33 23,121,081	129.37 24,450,930	2.41
11	MACQUARIE KOREA INFRA FUND	韓国	株式	その他	29,377	786.37 23,101,199	815.44 23,955,240	2.36
12	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラリア	株式	金融	10,400	2,133.58 22,189,321	2,175.09 22,620,988	2.23
13	WESTPAC BANKING CORP	オーストラリア	株式	金融	9,000	2,452.86 22,075,817	2,464.84 22,183,574	2.18
14	AMOREPACIFIC CORP	韓国	株式	生活必需品	520	37,879.80 19,697,496	38,999.40 20,279,688	2.00
15	RIO TINTO LTD	オーストラリア	株式	素材	5,500	3,640.43 20,022,604	3,573.54 19,654,478	1.93
16	DBS GROUP HOLDINGS LTD	シンガポール	株式	金融	15,300	1,237.48 18,933,987	1,250.99 19,140,262	1.88
17	SG FLEET GROUP LTD	オーストラリア	株式	資本財・サービス	56,000	276.17 15,465,923	314.49 17,611,485	1.73

18	ASX LTD	オーストラリア	株式	金融	4,600	3,408.31 15,678,244	3,553.58 16,346,497	1.61
19	TELSTRA CORP LTD	オーストラリア	株式	電気通信サービス	36,000	411.87 14,827,363	452.57 16,292,858	1.60
20	WOODSIDE PETROLEUM LTD	オーストラリア	株式	エネルギー	7,000	2,045.78 14,320,506	2,240.54 15,683,832	1.54
21	CLP HOLDINGS LTD	香港	株式	公益事業	15,000	1,043.89 15,658,594	1,038.87 15,583,050	1.53
22	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	情報技術	6,000	2,356.20 14,137,200	2,426.17 14,557,032	1.43
23	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	台湾	株式	金融	180,000	78.03 14,045,400	80.58 14,504,400	1.43
24	MANDO CORP	韓国	株式	一般消費財・サービス	700	20,962.03 14,673,422	20,572.65 14,400,855	1.42
25	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	-	25,000	531.60 13,290,030	570.71 14,267,825	1.40
26	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	中国	株式	金融	200,000	72.54 14,508,480	70.97 14,194,320	1.40
27	BINEX CO LTD	韓国	株式	ヘルスケア	8,000	1,800.69 14,405,520	1,763.37 14,106,960	1.39
28	SIRTEX MEDICAL LTD	オーストラリア	株式	ヘルスケア	5,500	2,459.81 13,529,389	2,523.90 13,881,496	1.37
29	BHP BILLITON LIMITED	オーストラリア	株式	素材	9,000	1,506.20 13,555,831	1,535.73 13,821,631	1.36
30	ENNOCONN CORP	台湾	株式	情報技術	9,000	1,506.20 13,555,800	1,496.00 13,464,000	1.33

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	90.81%
投資信託受益証券	1.22%
投資証券	2.50%
合計	94.54%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	1.54%
素材	9.34%
資本財・サービス	8.57%
一般消費財・サービス	11.22%
生活必需品	9.79%
ヘルスケア	5.93%
金融	21.00%
情報技術	14.84%
電気通信サービス	2.53%
公益事業	3.68%
その他	2.36%
合計	90.81%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

## ダイワ好配当日本株マザーファンド

## (1) 投資状況（平成28年5月31日現在）

## 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		37,859,020,860	88.62
	内 日本	37,859,020,860	88.62
投資証券		2,046,448,300	4.79
	内 日本	2,046,448,300	4.79
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		2,814,009,227	6.59
純資産総額		42,719,478,387	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)		1,550,000,000	3.63
	内 日本	1,550,000,000	3.63

(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28年5月31日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	数業種は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	241,600	5,007.00 1,209,691,200	4,855.00 1,172,968,000	2.75
2	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	-	10,971	101,300.00 1,111,362,300	96,300.00 1,056,507,300	2.47
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,873,000	554.54 1,038,663,720	553.80 1,037,267,400	2.43
4	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	900,700	1,019.50 918,263,650	1,125.00 1,013,287,500	2.37

5	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	244,300	3,516.00 858,958,800	3,617.00 883,633,100	2.07
6	あおぞら銀行	日本	株式	銀行業	2,290,000	383.00 877,070,000	377.00 863,330,000	2.02
7	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	300,000	2,730.50 819,150,000	2,779.00 833,700,000	1.95
8	MCUBS MidCity投資法人	日本	投資証券	-	2,131	354,000.00 754,374,000	376,000.00 801,256,000	1.88
9	日本航空	日本	株式	空運業	196,400	4,167.00 818,398,800	3,801.00 746,516,400	1.75
10	テクノプロ・ホールディング	日本	株式	サービス業	210,400	3,005.00 632,252,000	3,360.00 706,944,000	1.65
11	伊藤忠	日本	株式	卸売業	505,800	1,419.50 717,983,100	1,391.50 703,820,700	1.65
12	大東建託	日本	株式	建設業	35,400	15,735.00 557,019,000	16,095.00 569,763,000	1.33
13	シノケングループ	日本	株式	不動産業	199,500	2,336.00 466,032,000	2,761.00 550,819,500	1.29
14	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	94,400	5,740.00 541,856,000	5,783.00 545,915,200	1.28
15	ポーラ・オルビスHD	日本	株式	化学	55,500	9,310.00 516,705,000	9,600.00 532,800,000	1.25
16	日本ライフライン	日本	株式	卸売業	138,600	1,947.00 269,854,200	3,835.00 531,531,000	1.24
17	小野薬品	日本	株式	医薬品	106,000	5,054.00 535,724,000	4,924.00 521,944,000	1.22
18	トラスト・テック	日本	株式	サービス業	343,000	1,420.00 487,060,000	1,511.00 518,273,000	1.21
19	花王	日本	株式	化学	80,000	5,869.00 469,520,000	6,101.00 488,080,000	1.14
20	キリンHD	日本	株式	食料品	250,000	1,658.00 414,500,000	1,864.00 466,000,000	1.09
21	関東電化	日本	株式	化学	505,000	827.00 417,635,000	918.00 463,590,000	1.09
22	MS & AD	日本	株式	保険業	145,500	3,098.00 450,759,000	3,162.00 460,071,000	1.08
23	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	2,631,900	166.90 439,264,110	174.40 459,003,360	1.07
24	中国電力	日本	株式	電気・ガス業	320,000	1,456.00 465,920,000	1,389.00 444,480,000	1.04
25	住友ゴム	日本	株式	ゴム製品	260,000	1,676.00 435,760,000	1,630.00 423,800,000	0.99
26	西日本旅客鉄道	日本	株式	陸運業	60,000	6,716.00 402,960,000	6,934.00 416,040,000	0.97
27	三井物産	日本	株式	卸売業	300,000	1,336.50 400,950,000	1,335.00 400,500,000	0.94
28	日本たばこ産業	日本	株式	食料品	90,000	4,768.00 429,120,000	4,402.00 396,180,000	0.93
29	ローソン	日本	株式	小売業	45,000	8,680.00 390,600,000	8,770.00 394,650,000	0.92

30	東京海上HD	日本	株式	保険業	100,000	3,761.00 376,100,000	3,839.00 383,900,000	0.90
----	--------	----	----	-----	---------	-------------------------	-------------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	88.62%
投資証券	4.79%
合計	93.41%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	5.13%
食料品	2.30%
繊維製品	0.41%
パルプ・紙	0.64%
化学	6.99%
医薬品	2.41%
石油・石炭製品	1.11%
ゴム製品	1.62%
ガラス・土石製品	2.18%
鉄鋼	1.75%
非鉄金属	1.93%
金属製品	1.54%
機械	1.72%
電気機器	3.95%
輸送用機器	5.38%
その他製品	1.73%
電気・ガス業	1.71%
陸運業	1.99%
空運業	1.75%
倉庫・運輸関連業	0.11%
情報・通信業	7.87%
卸売業	9.52%
小売業	2.76%
銀行業	8.13%
保険業	2.65%
その他金融業	1.36%
不動産業	4.95%
サービス業	5.02%
合計	88.62%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2016年6月	買建	50	675,750,000	688,500,000	1.61%
		日経平均先物 2016年6月	買建	50	838,000,000	861,500,000	2.02%

(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。

### 【インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)】

#### (1) 【投資状況】(平成28年5月31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	1,188,312,389	99.03
内 日本	1,188,312,389	99.03
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,599,290	0.97
純資産総額	1,199,911,679	100.00

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

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

#### (2) 【投資資産】(平成28年5月31日現在)

##### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	513,998,771	1.6002 822,552,233	1.6223 833,860,206	69.49
2	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	52,767,044	2.2154 116,900,110	2.2736 119,971,151	10.00
3	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	29,476,016	1.9957 58,825,286	2.0060 59,128,888	4.93
4	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	23,547,549	2.5124 59,160,862	2.4525 57,750,363	4.81
5	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	27,712,155	1.3664 37,865,888	1.4401 39,908,274	3.33
6	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	19,452,058	1.9346 37,631,951	2.0158 39,211,458	3.27
7	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	21,724,088	1.7122 37,195,983	1.7714 38,482,049	3.21

(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	99.03%
合計	99.03%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

#### (3) 【運用実績】

##### 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第2特定期間末 (平成18年11月10日)	3,303,895,005	3,330,974,555	1.0884	1.0973
第3特定期間末 (平成19年5月10日)	6,348,295,670	6,402,292,024	1.1653	1.1752
第4特定期間末 (平成19年11月12日)	7,597,939,640	7,666,585,375	1.0955	1.1054
第5特定期間末 (平成20年5月12日)	6,966,783,065	7,036,210,388	1.0027	1.0127
第6特定期間末 (平成20年11月10日)	5,137,363,149	5,204,761,362	0.7622	0.7722
第7特定期間末 (平成21年5月11日)	5,082,311,828	5,148,143,388	0.7715	0.7815
第8特定期間末 (平成21年11月10日)	5,130,284,415	5,196,749,952	0.7708	0.7808
第9特定期間末 (平成22年5月10日)	4,747,854,086	4,811,653,675	0.7442	0.7542
第10特定期間末 (平成22年11月10日)	4,225,286,088	4,285,461,237	0.7022	0.7122
第11特定期間末 (平成23年5月10日)	3,784,311,567	3,838,978,686	0.6922	0.7022
第12特定期間末 (平成23年11月10日)	2,985,375,195	3,020,666,625	0.6344	0.6419
第13特定期間末 (平成24年5月10日)	2,635,394,990	2,655,696,722	0.6491	0.6541
第14特定期間末 (平成24年11月12日)	2,219,108,902	2,236,164,141	0.6506	0.6556



第15特定期間末 (平成25年5月10日)	2,478,019,937	2,492,374,885	0.8631	0.8681
第16特定期間末 (平成25年11月11日)	2,037,542,941	2,050,246,699	0.8019	0.8069
第17特定期間末 (平成26年5月12日)	1,862,809,605	1,873,889,871	0.8406	0.8456
第18特定期間末 (平成26年11月10日)	1,743,601,679	1,750,248,132	0.9182	0.9217
第19特定期間末 (平成27年5月11日)	1,566,235,861	1,572,032,654	0.9457	0.9492
平成27年5月末日	1,569,136,065	-	0.9618	-
6月末日	1,492,842,475	-	0.9395	-
7月末日	1,459,055,489	-	0.9431	-
8月末日	1,426,170,768	-	0.9115	-
9月末日	1,372,091,693	-	0.8913	-
10月末日	1,392,676,833	-	0.9100	-
第20特定期間末 (平成27年11月10日)	1,377,538,151	1,381,348,553	0.9038	0.9063
11月末日	1,380,625,236	-	0.9110	-
12月末日	1,317,937,218	-	0.8972	-
平成28年1月末日	1,295,185,402	-	0.8833	-
2月末日	1,221,911,470	-	0.8419	-
3月末日	1,246,664,358	-	0.8678	-
4月末日	1,197,063,891	-	0.8475	-
第21特定期間末 (平成28年5月10日)	1,182,765,323	1,186,295,037	0.8377	0.8402
5月末日	1,199,911,679	-	0.8499	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第2特定期間	0.0260
第3特定期間	0.0280
第4特定期間	0.0300
第5特定期間	0.0300
第6特定期間	0.0300
第7特定期間	0.0300
第8特定期間	0.0300
第9特定期間	0.0300
第10特定期間	0.0300
第11特定期間	0.0300
第12特定期間	0.0225
第13特定期間	0.0200
第14特定期間	0.0150
第15特定期間	0.0150
第16特定期間	0.0150
第17特定期間	0.0150
第18特定期間	0.0135

第19特定期間	0.0105
第20特定期間	0.0095
第21特定期間	0.0075

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

#### 【収益率の推移】

	収益率(%)
第2特定期間	7.8
第3特定期間	9.6
第4特定期間	3.4
第5特定期間	5.7
第6特定期間	21.0
第7特定期間	5.2
第8特定期間	3.8
第9特定期間	0.4
第10特定期間	1.6
第11特定期間	2.8
第12特定期間	5.1
第13特定期間	5.5
第14特定期間	2.5
第15特定期間	35.0
第16特定期間	5.4
第17特定期間	6.7
第18特定期間	10.8
第19特定期間	4.1
第20特定期間	3.4
第21特定期間	6.5

#### (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第2特定期間	2,363,634,810	22,245,139
第3特定期間	2,727,448,223	315,105,981
第4特定期間	1,799,847,583	312,149,776
第5特定期間	423,726,393	411,454,019
第6特定期間	213,869,039	421,945,239
第7特定期間	84,850,180	237,290,082
第8特定期間	189,497,121	121,502,962
第9特定期間	241,527,824	516,944,531
第10特定期間	104,295,368	466,739,317
第11特定期間	43,351,252	594,154,241
第12特定期間	38,330,975	799,518,890
第13特定期間	25,529,761	670,707,349
第14特定期間	14,620,571	663,919,130
第15特定期間	15,840,309	555,898,540
第16特定期間	15,453,145	345,691,091
第17特定期間	11,255,874	335,954,300
第18特定期間	9,451,531	326,518,165
第19特定期間	29,475,271	272,235,197
第20特定期間	46,300,831	178,366,471
第21特定期間	24,051,624	136,327,052

（参考）マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

## 【成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

## (1) 【投資状況】（平成28年5月31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	5,608,713,558	99.20
内 日本	5,608,713,558	99.20
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	45,021,171	0.80
純資産総額	5,653,734,729	100.00

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

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

## (2) 【投資資産】（平成28年5月31日現在）

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	869,471,047	2.2154 1,926,226,162	2.2736 1,976,829,372	34.97
2	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	685,897,044	1.6003 1,097,641,048	1.6223 1,112,730,774	19.68
3	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	461,699,571	1.3664 630,866,295	1.4401 664,893,552	11.76
4	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	327,277,696	1.9346 633,151,437	2.0158 659,726,379	11.67
5	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	363,216,608	1.7122 621,907,872	1.7714 643,401,899	11.38
6	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	139,143,727	1.9957 277,689,143	2.0060 279,122,316	4.94
7	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	110,911,016	2.5124 278,652,841	2.4525 272,009,266	4.81

(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	99.20%
合計	99.20%

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

## ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第2特定期間末 (平成18年11月10日)	3,028,587,268	3,126,137,019	1.0506	1.0844
第3特定期間末 (平成19年5月10日)	20,149,767,057	20,583,109,523	1.1084	1.1323
第4特定期間末 (平成19年11月12日)	31,541,417,114	31,669,290,974	0.9864	0.9904
第5特定期間末 (平成20年5月12日)	27,088,263,431	27,212,249,921	0.8737	0.8777
第6特定期間末 (平成20年11月10日)	17,356,839,161	17,473,272,452	0.5963	0.6003
第7特定期間末 (平成21年5月11日)	17,160,751,063	17,274,735,906	0.6021	0.6061
第8特定期間末 (平成21年11月10日)	17,492,350,214	17,602,733,833	0.6336	0.6376
第9特定期間末 (平成22年5月10日)	15,970,647,028	16,070,526,287	0.6396	0.6436
第10特定期間末 (平成22年11月10日)	13,787,105,748	13,878,015,417	0.6066	0.6106
第11特定期間末 (平成23年5月10日)	12,945,429,976	13,026,625,221	0.6377	0.6417
第12特定期間末 (平成23年11月10日)	9,751,516,113	9,822,135,392	0.5523	0.5563
第13特定期間末 (平成24年5月10日)	9,250,480,800	9,313,005,488	0.5918	0.5958
第14特定期間末 (平成24年11月12日)	8,222,189,610	8,278,659,413	0.5824	0.5864
第15特定期間末 (平成25年5月10日)	10,860,474,430	10,910,648,846	0.8658	0.8698
第16特定期間末 (平成25年11月11日)	9,327,922,637	9,372,482,501	0.8373	0.8413
第17特定期間末 (平成26年5月12日)	8,513,202,227	8,552,128,762	0.8748	0.8788

第18特定期間末 (平成26年11月10日)	8,133,973,146	8,166,656,270	0.9955	0.9995
第19特定期間末 (平成27年5月11日)	7,225,488,064	7,395,649,150	1.0191	1.0431
平成27年5月末日	7,389,470,445	-	1.0478	-
6月末日	7,223,024,460	-	1.0270	-
7月末日	7,118,519,751	-	1.0306	-
8月末日	6,633,881,102	-	0.9719	-
9月末日	6,266,258,679	-	0.9234	-
10月末日	6,563,960,393	-	0.9755	-
第20特定期間末 (平成27年11月10日)	6,532,848,494	6,559,720,979	0.9724	0.9764
11月末日	6,510,359,873	-	0.9794	-
12月末日	6,309,268,448	-	0.9637	-
平成28年1月末日	5,968,199,780	-	0.9157	-
2月末日	5,551,292,586	-	0.8583	-
3月末日	5,783,917,897	-	0.8978	-
4月末日	5,653,221,272	-	0.8829	-
第21特定期間末 (平成28年5月10日)	5,551,044,127	5,576,599,040	0.8689	0.8729
5月末日	5,653,734,729	-	0.8906	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第2特定期間	0.0720
第3特定期間	0.1020
第4特定期間	0.0420
第5特定期間	0.0120
第6特定期間	0.0120
第7特定期間	0.0120
第8特定期間	0.0120
第9特定期間	0.0120
第10特定期間	0.0120
第11特定期間	0.0120
第12特定期間	0.0120
第13特定期間	0.0120
第14特定期間	0.0120
第15特定期間	0.0120
第16特定期間	0.0120
第17特定期間	0.0120
第18特定期間	0.0120
第19特定期間	0.0620
第20特定期間	0.0120
第21特定期間	0.0120

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

## 【収益率の推移】

	収益率(%)
--	--------

第2特定期間	2.8
第3特定期間	15.2
第4特定期間	7.2
第5特定期間	10.2
第6特定期間	30.4
第7特定期間	3.0
第8特定期間	7.2
第9特定期間	2.8
第10特定期間	3.3
第11特定期間	7.1
第12特定期間	11.5
第13特定期間	9.3
第14特定期間	0.4
第15特定期間	50.7
第16特定期間	1.9
第17特定期間	5.9
第18特定期間	15.2
第19特定期間	8.6
第20特定期間	3.4
第21特定期間	9.4

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第2特定期間	2,435,507,421	21,714,884
第3特定期間	15,546,370,534	250,183,016
第4特定期間	14,582,776,935	785,579,088
第5特定期間	600,862,589	1,572,719,143
第6特定期間	191,255,824	2,087,048,820
第7特定期間	209,074,004	814,109,713
第8特定期間	196,014,849	1,092,280,415
第9特定期間	94,460,544	2,731,787,121
第10特定期間	80,269,976	2,322,667,589
第11特定期間	93,140,306	2,521,746,174
第12特定期間	60,003,410	2,703,995,028
第13特定期間	55,178,530	2,078,826,213
第14特定期間	53,311,081	1,567,032,356
第15特定期間	68,212,204	1,642,058,854
第16特定期間	42,879,794	1,446,517,832
第17特定期間	54,417,883	1,462,750,164
第18特定期間	33,525,544	1,594,378,200
第19特定期間	75,174,262	1,155,910,225
第20特定期間	80,486,286	452,410,273
第21特定期間	25,129,059	354,521,879

(参考) マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

#### ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

#### ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

#### ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

#### ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

#### ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

#### ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

[次へ](#)



## (参考情報) 運用実績

## 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

2016年5月31日現在

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

## 基準価額・純資産の推移

基準価額	9,109円
純資産総額	12億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.5%
3カ月間	1.7%
6カ月間	-2.8%
1年間	-5.5%
3年間	12.0%
5年間	38.4%
設定来	40.6%



※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： 285円 設定来分配金合計額： 3,825円

決算期	第52期	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期
	14年7月	14年9月	14年11月	15年1月	15年3月	15年5月	15年7月	15年9月	15年11月	16年1月	16年3月	16年5月
分配金	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	50円	35円

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国債券・先物	37	34.5%	日本円	50.4%	直接利回り(%)	日本電信電話	日本	0.3%	
国内債券	87	34.2%	米ドル	14.6%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.2%	
国内株式・先物	137	9.2%	ユーロ	10.8%	修正デュレーション	日産自動車	日本	0.2%	
外国株式	167	8.5%	豪ドル	6.2%	残存年数	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	0.2%	
外国リート等	127	5.7%	英ポンド	5.7%	債券格付別構成	三井住友フィナンシャルG	日本	0.2%	
国内リート	47	5.2%	カナダ・ドル	4.5%	AAA	30.4%	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	0.4%
外国投資信託	1	0.0%	ポーランド・ズロチ	2.8%	AA	57.5%	日本ビルファンド	日本	0.4%
			スウェーデン・クローネ	1.1%	A	12.1%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
			韓国ウォン	0.7%	BBB	-	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.3%
コール・ローン、その他		4.2%	その他	3.2%	BB	-	KLEPIERRE	フランス	0.3%
合計	603	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	3.0%	

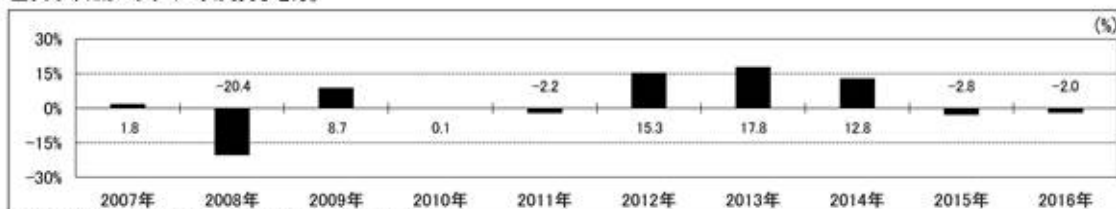
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※債券格付別構成について、日系発行体はR&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。

※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。

※2016年は5月31日までの騰落率を表しています。

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

## (参考情報) 運用実績

## インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

2016年5月31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	8,499円
純資産総額	11億円

## 基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	0.6%
3カ月間	1.6%
6カ月間	-5.9%
1年間	-9.9%
3年間	10.5%
5年間	46.8%
設定来	46.8%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：170円 設定来分配金合計額：4,515円

決算期	第52期	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期
	14年7月	14年9月	14年11月	15年1月	15年3月	15年5月	15年7月	15年9月	15年11月	16年1月	16年3月	16年5月
分配金	50円	50円	35円	35円	35円	35円	35円	35円	25円	25円	25円	25円

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国債券・先物	37	68.7%	米ドル	23.3%	直接利回り(%)	日本電信電話	日本	0.3%	
国内株式・先物	137	9.2%	ユーロ	19.6%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.2%	
外国株式	167	8.4%	日本円	16.0%	修正デュレーション	日産自動車	日本	0.2%	
外国リート等	127	5.7%	豪ドル	10.2%	残存年数	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	0.2%	
国内リート	47	5.2%	英ポンド	9.8%	債券格付別構成	三井住友フィナンシャルG	日本	0.2%	
外国投資信託	1	0.0%	カナダドル	8.8%	AAA	61.7%	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	0.4%
			ポーランド・ズロチ	5.5%	AA	13.8%	日本ビルファンド	日本	0.4%
			スウェーデン・クローネ	1.9%	A	24.5%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
			デンマーク・クローネ	1.4%	BBB	-	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.3%
コール・ローン、その他		5.5%	その他	3.5%	BB	-	KLEPIERRE	フランス	0.3%
合計	516	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	3.0%	

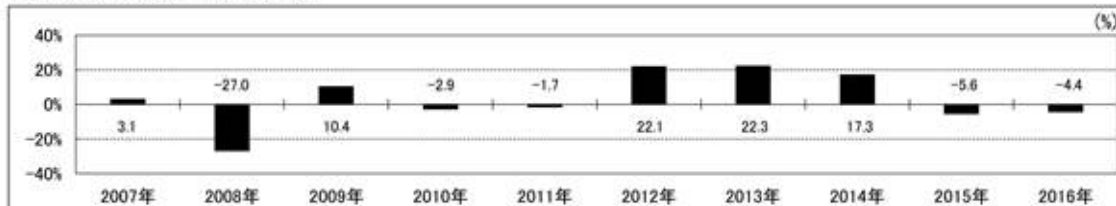
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※債券格付別構成について、日系発行体はR&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2016年は5月31日までの騰落率を表しています。

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

(参考情報) 運用実績

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

2016年5月31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	8,906円
純資産総額	56億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1か月間	1.3%
3か月間	4.7%
6か月間	-7.8%
1年間	-12.8%
3年間	21.6%
5年間	72.3%
設定来	56.8%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 240円 設定来分配金合計額: 5,070円

決算期	第52期	第53期	第54期	第55期	第56期	第57期	第58期	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期
	14年7月	14年9月	14年11月	15年1月	15年3月	15年5月	15年7月	15年9月	15年11月	16年1月	16年3月	16年5月
分配金	40円	40円	40円	140円	240円	240円	40円	40円	40円	40円	40円	40円

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

## 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式・先物	137	32.3%	日本円	41.0%	直接利回り(%)	日本電信電話	日本	1.0%	
外国株式	167	29.7%	米ドル	18.9%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.8%	
外国債券・先物	37	19.5%	ユーロ	10.4%	修正デュレーション	日産自動車	日本	0.8%	
外国リート等	127	7.9%	豪ドル	7.6%	残存年数	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	0.7%	
国内リート	47	6.4%	英ポンド	6.5%	債券格付別構成	三井住友フィナンシャルG	日本	0.7%	
外国投資信託	1	0.1%	カナダドル	2.8%	AAA	61.7%	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	1.0%
			韓国ウォン	2.5%	AA	13.8%	MCUBS MidCity投資法人	日本	0.7%
			スウェーデン・クローネ	1.7%	A	24.5%	日本ビルファンド	日本	0.4%
			香港ドル	1.7%	BBB	-	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
コール・ローン、その他		6.1%	その他	6.8%	BB	-	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	0.3%
合計	516	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	6.9%	

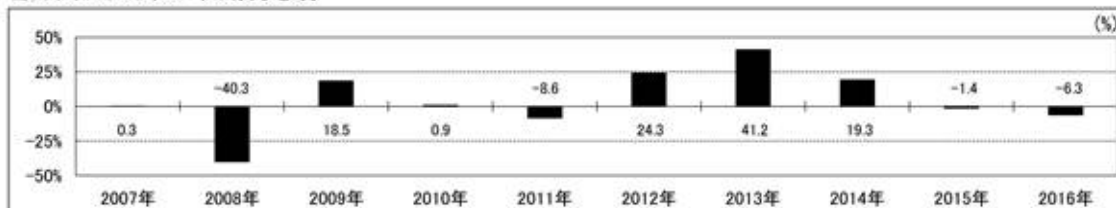
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※債券格付別構成について、日系発行体はR&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの順で格付けを採用し、海外発行体はMoody's、S&Pの格付けの高い方を採用し、算出しています。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計額を表示していません。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2016年は5月31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。

## 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(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) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成27年11月11日から平成28年5月10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】

#### 【安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

## (1) 【貸借対照表】

	前 期 平成27年11月10日現在		当 期 平成28年5月10日現在	
	金 額（円）		金 額（円）	
資産の部				
流動資産				
コール・ローン		22,492,930		19,284,662
親投資信託受益証券		1,320,035,930		1,264,050,999
未収入金		-		2,000,000
流動資産合計		1,342,528,860		1,285,335,661
資産合計		1,342,528,860		1,285,335,661
負債の部				
流動負債				
未払収益分配金		7,042,385		4,952,374
未払解約金		259,716		1,725,022
未払受託者報酬		120,174		116,464
未払委託者報酬		2,764,177		2,678,880
その他未払費用		56,051		52,286
流動負債合計		10,242,503		9,525,026
負債合計		10,242,503		9,525,026
純資産の部				
元本等				
元本	1	1,408,477,121		1,414,964,198
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	76,190,764		139,153,563
（分配準備積立金）		20,058,747		10,399,584
元本等合計		1,332,286,357		1,275,810,635
純資産合計		1,332,286,357		1,275,810,635
負債純資産合計		1,342,528,860		1,285,335,661

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 平成27年5月12日 至 平成27年11月10日 金 額 ( 円 )	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日 金 額 ( 円 )
営業収益		
受取利息	4,491	2,554
有価証券売買等損益	20,441,734	34,984,931
営業収益合計	20,437,243	34,982,377
営業費用		
支払利息	-	489
受託者報酬	374,247	348,942
委託者報酬	8,608,398	8,026,437
その他費用	56,051	52,286
営業費用合計	9,038,696	8,428,154
営業損失 ( )	29,475,939	43,410,531
経常損失 ( )	29,475,939	43,410,531
当期純損失 ( )	29,475,939	43,410,531
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	1,208,019	119,968
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	27,033,677	76,190,764
剰余金増加額又は欠損金減少額	3,851,694	5,221,470
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	3,851,694	5,221,470
剰余金減少額又は欠損金増加額	962,156	5,613,410
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	962,156	5,613,410
分配金	21,362,667	19,040,360
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	76,190,764	139,153,563

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 平成27年11月11日	至 平成28年5月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1. 1 期首元本額	1,493,173,075円	1,408,477,121円
期中追加設定元本額	28,106,161円	74,111,919円
期中一部解約元本額	112,802,115円	67,624,842円
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,408,477,121口	1,414,964,198口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は76,190,764円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は139,153,563円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成27年5月12日 至 平成27年11月10日	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	372,660円	347,010円
2. 2 分配金の計算過程	（自平成27年5月12日 至平成27年7月10日） 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（3,006,127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（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（868,752円）及び分配準備積立金（32,627,106円）より分配対象額は36,501,985円（1万口当たり251.69円）であり、うち7,251,495円（1万口当たり50円）を分配金額としております。	（自平成27年11月11日 至平成28年1月12日） 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（1,943,310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（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,505,716円）及び分配準備積立金（19,665,845円）より分配対象額は23,114,871円（1万口当たり165.37円）であり、うち6,988,943円（1万口当たり50円）を分配金額としております。

<p>（自平成27年7月11日 至平成27年9月10日）          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（2,420,047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（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,141,698円）及び分配準備積立金（27,382,354円）より分配対象額は30,944,099円（1万口当たり218.88円）であり、うち7,068,787円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成27年9月11日 至平成27年11月10日）          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（4,569,972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（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,259,265円）及び分配準備積立金（22,531,160円）より分配対象額は28,360,397円（1万口当たり201.36円）であり、うち7,042,385円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成28年1月13日 至平成28年3月10日）          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（2,912,351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（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,921,322円）及び分配準備積立金（14,482,049円）より分配対象額は19,315,722円（1万口当たり136.04円）であり、うち7,099,043円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成27年9月11日 至平成27年11月10日）          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（4,569,972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（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,259,265円）及び分配準備積立金（22,531,160円）より分配対象額は28,360,397円（1万口当たり201.36円）であり、うち7,042,385円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成28年3月11日 至平成28年5月10日）          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（3,436,182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（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（294,912円）及び分配準備積立金（11,915,776円）より分配対象額は15,646,870円（1万口当たり110.58円）であり、うち4,952,374円（1万口当たり35円）を分配金額としております。</p>	

## （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	当 期 自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10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等であり、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	当 期 平成28年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	前 期 平成27年11月10日現在	当 期 平成28年5月10日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	25,761,905	1,122,473
合計	25,761,905	1,122,473

## (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

前 期 平成27年11月10日現在	当 期 平成28年5月10日現在
該当事項はありません。	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)

当 期 自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10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なわれていないため、該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	前 期 平成27年11月10日現在	当 期 平成28年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9459円 (9,459円)	0.9017円 (9,017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	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	275,489,966	440,866,592	
	ダイワ日本国債マザーファンド	355,839,667	449,959,258	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	31,777,145	63,417,648	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	56,481,381	125,128,851	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	21,263,834	41,137,013	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	29,733,453	40,627,790	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	22,958,417	39,309,401	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	25,316,210	63,604,446	
親投資信託受益証券 合計			1,264,050,999	
合計			1,264,050,999	

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、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」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、当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	948,060,250	813,678,893
コール・ローン	436,226,367	21,619,462
国債証券	45,195,344,450	36,064,720,797
特殊債券	472,723,200	1,854,802,333
派生商品評価勘定	99,490,579	434,973,630
未収入金	2,542,702,820	-
未収利息	166,628,705	254,273,237
前払費用	147,419,429	121,932,571
差入委託証拠金	764,065,176	588,313,793
流動資産合計	50,772,660,976	40,154,314,716
資産合計	50,772,660,976	40,154,314,716
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	38,970,127	276,308,244
未払金	962,538,500	-
未払解約金	164,727,000	22,300,000
その他未払費用	-	804
流動負債合計	1,166,235,627	298,609,048
負債合計	1,166,235,627	298,609,048
純資産の部		
元本等		
元本	1 29,149,846,881	24,905,225,364
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	20,456,578,468	14,950,480,304
元本等合計	49,606,425,349	39,855,705,668
純資産合計	49,606,425,349	39,855,705,668
負債純資産合計	50,772,660,976	40,154,314,716

#### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 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27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	<p>平成27年5月12日 33,743,211,499円 67,629,908円 4,660,994,526円</p>	<p>平成27年11月11日 29,149,846,881円 58,867,613円 4,303,489,130円</p>
期末元本額の内訳 ファンド名		
ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）	2,550,581,805円	2,401,424,895円
富山応援ファンド（地域企業株・外債バランス / 毎月分配型）	771,179,034円	759,246,956円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	1,428,127,107円	1,351,951,741円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	67,877,831円	61,444,411円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	271,161,698円	275,489,966円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	562,478,936円	514,618,965円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	756,582,519円	692,740,491円
FITネット・三県応援ファンド（毎月分配型）	293,700,776円	- 円
長野応援ファンド（毎月分配型）	426,934,250円	- 円
栃木応援・外債バランスファンド（毎月分配型）	259,289,456円	- 円

京都応援バランスファンド(隔月分配型)	311,538,359円	290,551,560円
北東北三県応援・外債バランスファンド(毎月分配型)	248,897,751円	206,210,764円
6資産バランスファンド(分配型)	1,681,667,042円	1,605,754,140円
6資産バランスファンド(成長型)	159,462,497円	159,974,112円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(毎月分配型)	14,361,302,765円	12,732,496,161円
富山応援ファンドPART2(地域企業株・外債バランス/隔月分配型)	419,794,083円	-円
奈良応援ファンド(外債バランス・毎月分配型)	134,378,440円	-円
ダイワ三資産分散ファンド(インカム&キャッシュ、外債、内外リート)(隔月分配型)	354,301,737円	-円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	111,423,840円	103,071,442円
ダイワ外債ソブリン・ファンド(毎月分配型)	1,440,505,585円	1,377,742,115円
兵庫応援バランスファンド(毎月分配型)	117,678,237円	111,107,260円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	33,407,695円	31,068,081円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	378,214,775円	355,326,105円
紀陽地域株式・外債バランスファンド(隔月分配型)	82,634,626円	69,079,156円
愛媛県応援ファンド(外債バランス・毎月分配型)	84,984,008円	82,096,445円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	1,666,662,675円	1,558,002,663円
地球環境株・外債バランス・ファンド	108,003,876円	105,074,959円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(1年決算型)	67,075,478円	60,752,976円
計	29,149,846,881円	24,905,225,364円
2. 期末日における受益権の総数	29,149,846,881口	24,905,225,364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27年11月11日 至 平成28年5月10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等であり、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。 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（外国の取引所）における債券先物取引を利用してあります。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。 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28年5月10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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
国債証券	685,312,959	102,569,273
特殊債券	3,410,400	6,583,548
合計	688,723,359	95,985,725

（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27年10月14日から平成27年11月10日まで、及び平成28年4月12日から平成28年5月10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. 債券関連

種 類	平成27年11月10日 現在				平成28年5月10日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								

債券先物取引								
売 建	13,185,072,221	-	13,120,462,586	64,609,635	3,758,826,930	-	3,764,305,999	5,479,069
買 建	6,716,710,000	-	6,719,212,500	2,502,500	1,963,491,000	-	1,954,723,210	8,767,790
合計	19,901,782,221	-	19,839,675,086	67,112,135	5,722,317,930	-	5,719,029,209	14,246,859

## (注) 1. 時価の算定方法

債券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。

- 債券先物取引の残高は、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27年11月10日 現在				平成28年5月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	8,422,018,227	-	8,435,667,387	13,649,160	7,658,119,928	-	7,223,841,403	434,278,525
アメリカ・ドル	917,016,750	-	916,244,355	772,395	108,456,000	-	108,450,000	6,000
イギリス・ポンド	1,489,320,000	-	1,489,680,000	360,000	78,126,000	-	78,125,000	1,000
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	4,721,164,000	-	4,394,495,000	326,669,000
カナダ・ドル	278,377,500	-	278,370,000	7,500	2,682,309,428	-	2,574,711,403	107,598,025
スウェーデン・クローナ	-	-	-	-	26,562,000	-	26,560,000	2,000
デンマーク・クローネ	-	-	-	-	41,502,500	-	41,500,000	2,500
ノルウェー・クローネ	57,000,000	-	56,840,000	160,000	-	-	-	-
ユーロ	5,680,303,977	-	5,694,533,032	14,229,055	-	-	-	-
買 建	7,234,943,727	-	7,242,001,204	7,057,477	7,280,328,728	-	7,018,962,448	261,366,280
アメリカ・ドル	1,134,584,871	-	1,140,775,437	6,190,566	-	-	-	-
イギリス・ポンド	1,120,087,067	-	1,117,260,000	2,827,067	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	560,670,000	-	560,692,929	22,929	2,598,728,728	-	2,454,580,000	144,148,728
カナダ・ドル	2,397,472,628	-	2,412,020,000	14,547,372	4,681,600,000	-	4,564,382,448	117,217,552
スウェーデン・クローナ	365,853,411	-	368,680,000	2,826,589	-	-	-	-
ポーランド・ズロチ	557,190,000	-	553,876,914	3,313,086	-	-	-	-
ユーロ	1,099,085,750	-	1,088,695,924	10,389,826	-	-	-	-
合計	15,656,961,954	-	15,677,668,591	6,591,683	14,938,448,656	-	14,242,803,851	172,912,245

## (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。

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7018円 (17,018円)	1.6003円 (16,003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	0.75% United States Treasury Note/Bond 20171031	5,000,000.000	5,005,650.000	
		0.25% US Treasury Inflation Indexed Bonds 20250115	12,500,000.000	12,626,717.790	
		2% United States Treasury Note/Bond 20250815	20,000,000.000	20,459,200.000	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	11,000,000.000	11,485,540.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	16,000,000.000	15,809,920.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	12,500,000.000	12,190,375.000	
		5.625% Mexico Government International Bond 20170115	3,000,000.000	3,088,500.000	
		5.125% Mexico Government International Bond 20200115	8,000,000.000	8,840,000.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 89,505,902.790 (9,707,810,217)	
	イギリス・ポンド		5% United Kingdom Gilt 20250307	10,500,000.000	13,732,950.000
4.25% United Kingdom Gilt 20461207			3,000,000.000	4,322,700.000	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 18,055,650.000 (2,821,375,869)		
オーストラリア・ドル		5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	25,000,000.000	29,727,750.000	
		3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20250421	26,000,000.000	28,062,060.000	



オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 57,789,810.000 (4,576,952,952)	
カナダ・ドル	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	カナダ・ドル 10,000,000.000	カナダ・ドル 11,108,400.000	
	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,500,000.000	2,012,250.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	15,000,000.000	16,321,500.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	8,000,000.000	8,134,000.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 37,576,150.000 (3,140,990,379)	
スウェーデン・ク ローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	スウェーデン・クローナ 22,000,000.000	スウェーデン・クローナ 27,197,720.000	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	35,000,000.000	37,948,050.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 65,145,770.000 (865,135,826)	
デンマーク・ク ローネ	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	デンマーク・クローネ 41,000,000.000	デンマーク・クローネ 46,225,860.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 46,225,860.000 (767,349,276)	
ノルウェー・ク ローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	ノルウェー・クローネ 25,000,000.000	ノルウェー・クローネ 28,544,000.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	4,000,000.000	4,251,520.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 32,795,520.000 (432,572,908)	
ポーランド・ズロ チ	5.25% Poland Government Bond 20201025	ポーランド・ズロチ 50,000,000.000	ポーランド・ズロチ 56,900,000.000	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	55,000,000.000	64,729,500.000	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 121,629,500.000 (3,388,597,870)	
ユーロ	0.8% Belgium Government Bond 20250622	ユーロ 34,000,000.000	ユーロ 35,223,660.000	
	4.375% Slovenia Government Bond 20210118	8,000,000.000	9,523,760.000	
	3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	3,500,000.000	4,977,875.000	
	1.85% FRENCH GOVERNMENT BOND 20270725	3,000,000.000	4,091,100.640	
	5.4% IRISH TREASURY 20250313	15,800,000.000	22,016,826.000	
	1% IRISH TREASURY 20260515	8,000,000.000	8,092,080.000	
ユーロ 小計			ユーロ 83,925,301.640 (10,363,935,500)	

国債証券 合計				36,064,720,797 [36,064,720,797]	
特殊債券	カナダ・ドル	2.55% CANADA HOUSING TRUST 20250315	カナダ・ドル 4,500,000.000	カナダ・ドル 4,811,355.000	
		1.25% CANADA HOUSING TRUST 20210615	5,000,000.000	5,024,750.000	
		2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	7,000,000.000	7,270,830.000	
		2.3% Japan Bank For International Cooperation 20180319	5,000,000.000	5,082,350.000	
	カナダ・ドル 小計		カナダ・ドル 22,189,285.000 (1,854,802,333)		
特殊債券 合計				1,854,802,333 [1,854,802,333]	
合計				37,919,523,130 [37,919,523,130]	

- (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 8銘柄	100%	25.6%
イギリス・ポンド	国債証券 2銘柄	100%	7.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 2銘柄	100%	12.1%
カナダ・ドル	国債証券 4銘柄	100%	13.2%
	特殊債券 4銘柄		
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	100%	2.3%
デンマーク・クローネ	国債証券 1銘柄	100%	2.0%
ノルウェー・クローネ	国債証券 2銘柄	100%	1.1%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	100%	8.9%
ユーロ	国債証券 6銘柄	100%	27.4%

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](#)

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

## 貸借対照表

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,790,524,971	1,205,080,671
国債証券	431,220,004,745	422,882,270,910
未収利息	1,829,060,667	1,880,856,550
前払費用	102,693,103	66,966,813
流動資産合計	434,942,283,486	426,035,174,944
資産合計	434,942,283,486	426,035,174,944
負債の部		
流動負債		
未払金	944,018,000	-
未払解約金	4,000,180	163,904,931
その他未払費用	-	2,091
流動負債合計	948,018,180	163,907,022
負債合計	948,018,180	163,907,022
純資産の部		
元本等		
元本	1 354,326,120,976	336,790,120,056
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	79,668,144,330	89,081,147,866
元本等合計	433,994,265,306	425,871,267,922
純資産合計	433,994,265,306	425,871,267,922
負債純資産合計	434,942,283,486	426,035,174,944

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1. 1期首	平成27年5月12日	平成27年11月11日
期首元本額	335,584,604,104円	354,326,120,976円
期中追加設定元本額	26,334,265,511円	29,962,568,093円
期中一部解約元本額	7,592,748,639円	47,498,569,013円

期末元本額の内訳 ファンド名		
ダイワ日本国債ファンドV A （適格機関投資家専用）	10,724,193円	11,107,510円
安定重視ポートフォリオ（奇数 月分配型）	384,695,699円	355,839,667円
6資産バランスファンド（分配 型）	468,002,919円	406,503,295円
6資産バランスファンド（成長 型）	223,383,652円	204,155,765円
ダイワ日本国債ファンド（毎月 分配型）	346,130,684,114円	326,670,984,012円
世界6資産均等分散ファンド （毎月分配型）	156,608,088円	132,570,839円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	73,961,611円	59,527,779円
ダイワ日本国債ファンド（年1 回決算型）	6,607,455,352円	8,693,625,761円
ダイワ・ニッポン応援ファンド Vol.4 - 日本の真価 - （国債 コース）	270,605,348円	255,805,428円
計	354,326,120,976円	336,790,120,056円
2. 期末日における受益権の総数	354,326,120,976口	336,790,120,056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27年11月11日 至 平成28年5月10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等であり、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28年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
国債証券	6,362,035	1,492,030,330
合計	6,362,035	1,492,030,330

(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27年3月11日から平成27年11月10日まで、及び平成28年3月11日から平成28年5月10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27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2248円 (12,248円)	1.2645円 (12,645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 4 4 2年国債	1,000,000,000	1,000,930,000	
	3 4 8 2年国債	500,000,000	500,985,000	
	3 4 9 2年国債	900,000,000	901,989,000	
	3 5 0 2年国債	100,000,000	100,261,000	
	3 5 2 2年国債	500,000,000	501,920,000	
	3 5 4 2年国債	300,000,000	301,326,000	
	3 5 5 2年国債	500,000,000	502,370,000	
	3 5 6 2年国債	700,000,000	703,591,000	
	3 5 7 2年国債	500,000,000	502,720,000	
	3 5 8 2年国債	500,000,000	502,885,000	
	3 6 0 2年国債	800,000,000	804,920,000	
	3 6 1 2年国債	700,000,000	704,529,000	
	1 0 7 5年国債	100,000,000	100,751,000	
	1 1 2 5年国債	200,000,000	202,796,000	
	1 1 4 5年国債	500,000,000	506,645,000	
	1 1 6 5年国債	200,000,000	202,388,000	
	1 2 2 5年国債	200,000,000	202,510,000	
	1 2 3 5年国債	2,500,000,000	2,533,050,000	
	2 8 1 10年国債	1,600,000,000	1,603,648,000	
	2 8 3 10年国債	1,900,000,000	1,913,433,000	
	2 8 4 10年国債	700,000,000	708,029,000	
	2 8 7 10年国債	350,000,000	358,431,500	

289	10年国債	1,000,000,000	1,028,500,000	
292	10年国債	1,000,000,000	1,036,430,000	
296	10年国債	2,150,000,000	2,239,526,000	
297	10年国債	1,200,000,000	1,251,816,000	
301	10年国債	300,000,000	316,389,000	
305	10年国債	900,000,000	950,445,000	
313	10年国債	2,300,000,000	2,472,753,000	
321	10年国債	1,000,000,000	1,073,310,000	
1	30年国債	8,450,000,000	11,587,485,000	
2	30年国債	5,600,000,000	7,426,160,000	
3	30年国債	7,500,000,000	9,877,200,000	
4	30年国債	8,100,000,000	11,429,100,000	
33	利付国債20年	11,194,000,000	11,353,514,500	
34	利付国債20年	9,219,000,000	9,511,426,680	
35	利付国債20年	300,000,000	309,003,000	
36	利付国債20年	770,000,000	804,334,300	
37	利付国債20年	10,723,000,000	11,215,829,080	
38	利付国債20年	8,726,000,000	9,207,326,160	
40	20年国債	11,742,000,000	12,452,391,000	
42	20年国債	10,218,000,000	11,055,262,920	
43	20年国債	14,172,000,000	15,676,074,360	
44	20年国債	7,585,000,000	8,388,706,600	
46	20年国債	3,900,000,000	4,293,432,000	
47	20年国債	8,050,000,000	8,911,833,000	
48	20年国債	6,001,000,000	6,762,886,960	
49	20年国債	4,618,000,000	5,144,313,460	
51	20年国債	4,600,000,000	5,131,668,000	
52	20年国債	7,368,000,000	8,299,904,640	
54	20年国債	6,787,000,000	7,724,013,220	
55	20年国債	4,904,000,000	5,553,289,600	
56	20年国債	5,370,000,000	6,109,824,900	
58	20年国債	8,325,000,000	9,466,191,000	
59	20年国債	6,495,000,000	7,331,166,300	
61	20年国債	4,800,000,000	5,207,520,000	
63	20年国債	5,708,000,000	6,535,717,080	
64	20年国債	7,735,000,000	8,948,157,400	
65	20年国債	6,077,000,000	7,057,463,180	
68	20年国債	4,605,000,000	5,478,200,100	
70	20年国債	8,288,000,000	10,034,696,000	
72	20年国債	5,800,000,000	6,907,568,000	
74	20年国債	4,815,000,000	5,759,751,150	
75	20年国債	4,474,000,000	5,370,097,460	
77	20年国債	236,000,000	281,153,880	
80	20年国債	9,023,000,000	10,872,354,080	
82	20年国債	4,865,000,000	5,884,460,750	
83	20年国債	5,650,000,000	6,855,879,500	
86	20年国債	3,500,000,000	4,329,570,000	
88	20年国債	8,660,000,000	10,765,505,800	
90	20年国債	1,700,000,000	2,103,767,000	
91	20年国債	4,700,000,000	5,865,365,000	
92	20年国債	3,970,000,000	4,890,722,400	
94	20年国債	3,900,000,000	4,823,013,000	
95	20年国債	6,905,000,000	8,722,188,850	

9 7	2 0 年国債	7,240,000,000	9,095,684,400	
9 9	2 0 年国債	3,800,000,000	4,748,366,000	
1 0 1	2 0 年国債	4,460,000,000	5,752,775,600	
1 0 2	2 0 年国債	8,020,000,000	10,381,729,600	
1 0 6	2 0 年国債	6,740,000,000	8,588,445,000	
1 0 7	2 0 年国債	3,500,000,000	4,432,260,000	
1 1 0	2 0 年国債	4,050,000,000	5,143,297,500	
1 1 1	2 0 年国債	3,550,000,000	4,567,643,000	
1 1 5	2 0 年国債	3,500,000,000	4,532,395,000	
1 2 1	2 0 年国債	3,300,000,000	4,173,312,000	
1 2 3	2 0 年国債	3,100,000,000	4,021,599,000	
国債証券 合計			422,882,270,910	
合計			422,882,270,910	

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](#)

## 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,611,685,737	911,773,486
コール・ローン	868,078,618	934,448,897
投資証券	151,150,162,718	137,078,550,410
派生商品評価勘定	342,053	39,367
未収入金	817,233,867	1,234,361,497
未収配当金	150,601,425	203,749,568
流動資産合計	155,598,104,418	140,362,923,225
資産合計	155,598,104,418	140,362,923,225
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	66,788
未払金	95,197,854	609,824,237
未払解約金	302,083,000	211,000,000
その他未払費用	-	1,893
流動負債合計	397,280,854	820,892,918
負債合計	397,280,854	820,892,918
純資産の部		
元本等		
元本	1 76,254,020,309	69,921,612,480
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	78,946,803,255	69,620,417,827
元本等合計	155,200,823,564	139,542,030,307
純資産合計	155,200,823,564	139,542,030,307
負債純資産合計	155,598,104,418	140,362,923,225

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引



	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	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27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1. 1 期首	平成27年5月12日	平成27年11月11日
期首元本額	85,146,137,974円	76,254,020,309円
期中追加設定元本額	273,761,477円	199,334,256円
期中一部解約元本額	9,165,879,142円	6,531,742,085円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルREIT・オープン(毎月分配型)	69,689,269,629円	63,775,345,788円
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	58,300,253円	49,818,322円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	31,243,179円	31,777,145円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	32,443,433円	29,985,804円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	155,183,156円	141,667,549円
6資産バランスファンド(分配型)	275,781,268円	263,812,844円
6資産バランスファンド(成長型)	558,963,077円	538,017,736円
ダイワ三資産分散ファンド(インカム&キャッシュ、外債、内外リート)(隔月分配型)	28,681,835円	-円
りそな ワールド・リート・ファンド	2,957,190,587円	2,722,442,188円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	92,317,550円	84,827,960円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	7,366,169円	6,765,297円
常陽3分法ファンド	423,956,051円	386,285,154円

ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	97,399,068円	90,437,022円
ダイワ・海外株式&REITファンド（毎月分配型）	33,292,034円	26,770,163円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	178,048,412円	187,634,535円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	231,267,176円	250,615,811円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	282,897,698円	298,741,001円
ダイワ・グローバルREITファンド（ダイワSMA専用）	225,242,395円	193,937,211円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（分配型）	837,614,314円	780,044,808円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド（部分為替ヘッジあり）	23,177,147円	26,164,583円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド（為替ヘッジなし）	34,385,878円	36,521,559円
計	76,254,020,309円	69,921,612,480円
2. 期末日における受益権の総数	76,254,020,309口	69,921,612,480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27年11月11日 至 平成28年5月10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等であり、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。 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28年5月10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等

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

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	6,553,508,603	7,316,731,456
合計	6,553,508,603	7,316,731,456

(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27年9月16日から平成27年11月10日まで、及び平成28年3月16日から平成28年5月10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27年11月10日 現在				平成28年5月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	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	384,642,640	-	384,353,890	288,750	419,079,943	-	419,079,910	33
アメリカ・ドル	308,263,750	-	307,975,000	288,750	231,985,027	-	231,967,638	17,389
ユーロ	76,378,890	-	76,378,890	0	187,094,916	-	187,112,272	17,356
買 建	76,378,890	-	76,432,193	53,303	310,623,943	-	310,596,489	27,454
アメリカ・ドル	76,378,890	-	76,432,193	53,303	187,094,916	-	187,116,894	21,978
イギリス・ポンド	-	-	-	-	123,529,027	-	123,479,595	49,432
合計	461,021,530	-	460,786,083	342,053	729,703,886	-	729,676,399	27,421

## (注) 1. 時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## （1口当たり情報）

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2,0353円 (20,353円)	1,9957円 (19,957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	SIMON PROPERTY GROUP INC	394,342	84,010,619.680		
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	954,954	41,091,670.620		
		VORNADO REALTY TRUST	268,702	26,034,536.780		
		QTS REALTY TRUST INC-CL A	199,111	10,345,807.560		
		EQUITY RESIDENTIAL	337,107	24,231,251.160		
		EQUINIX INC	49,301	16,813,613.040		
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	357,280	6,799,038.400		
		HOST HOTELS & RESORTS INC	791,668	12,991,271.880		
		PHYSICIANS REALTY TRUST	496,553	9,712,576.680		
		STORE CAPITAL CORP	244,331	6,501,647.910		
		PARAMOUNT GROUP INC	1,196	20,631.000		
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	722,619	19,207,213.020		
		CROWN CASTLE INTL CORP	71,420	6,389,947.400		
		SPIRIT REALTY CAPITAL INC	825,556	9,799,349.720		
		SUN COMMUNITIES INC	230,551	16,844,056.060		
		PROLOGIS INC	740,856	35,035,080.240		
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	53,552	5,165,625.920		
		CAMDEN PROPERTY TRUST	187,611	16,158,935.430		
		COUSINS PROPERTIES INC	885,600	9,511,344.000		
		DDR CORP	1,242,404	22,897,505.720		
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	77,379	18,068,770.290		
		WELLTOWER INC	181,664	13,570,300.800		
		HCP INC	655,245	23,582,267.550		
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	203,479	9,939,949.150		
		KILROY REALTY CORP	293,516	19,213,557.360		
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	175,330	13,230,401.800		
		PENN REAL ESTATE INVEST TST	466,886	11,116,555.660		
		REGENCY CENTERS CORP	207,396	16,456,872.600		
		RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	685,960	12,868,609.600		
		SL GREEN REALTY CORP	211,003	22,284,026.830		
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	458,783	15,860,128.310		
		CUBESMART	637,214	20,397,220.140		
		DIGITAL REALTY TRUST INC	210,248	19,586,703.680		
EXTRA SPACE STORAGE INC	435,723	40,674,742.050				
EDUCATION REALTY TRUST INC	228,096	9,741,980.160				
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 646,153,808.200 (70,081,842,038)		
	イギリス・ポンド			イギリス・ポンド		
		ASSURA PLC	18,452,853		10,647,296.180	
		CAPITAL & REGIONAL PLC	9,753,592		6,242,298.880	
		SEGRO PLC	4,483,728		19,297,965.310	
		HAMMERSON PLC	7,104,813		41,669,728.240	
	BRITISH LAND CO PLC	1,178,694	8,692,868.250			

	BIG YELLOW GROUP PLC	2,260,211	19,121,385.060
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	3,309,038	5,426,822.320
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 111,098,364.240 (17,360,230,395)
オーストラリア・ドル	NATIONAL STORAGE REIT	7,097,645	13,059,666.800
	SCENTRE GROUP	13,684,878	63,634,682.700
	DEXUS PROPERTY GROUP	4,734,541	40,480,325.550
	MIRVAC GROUP	5,208,967	10,157,485.650
	WESTFIELD CORP	2,673,972	27,969,747.120
	VICINITY CENTRES	21,959,491	74,662,269.400
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	5,981,161	16,448,192.750
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 246,412,369.970 (19,515,859,702)
カナダ・ドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	528,941	カナダ・ドル 19,301,057.090
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 19,301,057.090 (1,613,375,362)
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	20,389,571	シンガポール・ドル 22,224,632.390
	CAPITALAND MALL TRUST	11,318,700	24,108,831.000
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	7,618,900	15,313,989.000
シンガポール・ドル	小計		シンガポール・ドル 61,647,452.390 (4,875,080,534)
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	741,825	ユーロ 9,142,993.120
	WERELDHAVE NV	339,177	15,371,501.640
	NSI NV	2,031,179	8,195,807.260
	KLEPIERRE	1,704,158	70,748,119.370
	FONCIERE DES REGIONS	180,536	14,910,468.240
	BENI STABILI SPA	14,980,758	9,527,762.080
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	558,116	4,939,326.600
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	1,125,647	10,963,801.780
ユーロ	小計		ユーロ 143,799,780.090 (17,757,834,844)
香港・ドル	FORTUNE REIT	15,935,070	香港・ドル 134,332,640.100
	LINK REIT	4,779,920	224,895,236.000
	CHAMPION REIT	14,763,376	61,268,010.400
香港・ドル	小計		香港・ドル 420,495,886.500 (5,874,327,535)
投資証券	合計		137,078,550,410 [137,078,550,410]
合計			137,078,550,410 [137,078,550,410]

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 35銘柄	100%	51.0%
イギリス・ポンド	投資証券 7銘柄	100%	12.7%
オーストラリア・ドル	投資証券 7銘柄	100%	14.2%
カナダ・ドル	投資証券 1銘柄	100%	1.2%
シンガポール・ドル	投資証券 3銘柄	100%	3.6%
ユーロ	投資証券 8銘柄	100%	13.0%
香港・ドル	投資証券 3銘柄	100%	4.3%

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](#)

## 「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,293,453,694	1,095,635,539
投資証券	72,354,553,000	81,421,370,000
未収入金	62,064,122	408,949,596
未収配当金	576,978,480	639,464,276
流動資産合計	74,287,049,296	83,565,419,411
資産合計	74,287,049,296	83,565,419,411
負債の部		
流動負債		
未払金	283,265,842	212,199,870
未払解約金	12,032,000	338,747,000
その他未払費用	-	2,455
流動負債合計	295,297,842	550,949,325
負債合計	295,297,842	550,949,325
純資産の部		
元本等		
元本	1 34,228,198,951	33,041,891,516
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	39,763,552,503	49,972,578,570
元本等合計	73,991,751,454	83,014,470,086
純資産合計	73,991,751,454	83,014,470,086
負債純資産合計	74,287,049,296	83,565,419,411

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1. 1期首	平成27年5月12日	平成27年11月11日

期首元本額	30,357,414,771円	34,228,198,951円
期中追加設定元本額	5,491,747,501円	1,683,805,288円
期中一部解約元本額	1,620,963,321円	2,870,112,723円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	29,980,743円	25,316,210円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	31,284,848円	23,547,549円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	149,446,393円	111,711,360円
6資産バランスファンド（分配型）	265,244,531円	208,279,396円
6資産バランスファンド（成長型）	535,281,033円	427,218,157円
ダイワ三資産分散ファンド（インカム&キャッシュ、外債、内外リート）（隔月分配型）	27,888,605円	- 円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	89,010,489円	69,399,821円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	3,360,756円	2,667,476円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	93,569,209円	72,139,943円
成果リレー（ブラジル国債&J-REIT）2014-07	189,659,371円	104,641,905円
成果リレー（ブラジル国債&J-REIT）2014-08	144,108,589円	90,792,091円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	168,337,856円	153,474,121円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	223,520,278円	206,009,488円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	270,736,177円	254,195,760円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	373,826,791円	443,613,916円
ダイワファンドラップ J-REIT セレクト	30,561,762,111円	30,009,627,863円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（成長型）	192,047,048円	156,117,010円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（安定型）	54,072,852円	46,008,611円
ライフハーモニー（ダイワ世界資産分散ファンド）（分配型）	336,536,562円	255,432,873円
ダイワJリート・ファンド	488,524,709円	381,697,966円
計	34,228,198,951円	33,041,891,516円
2. 期末日における受益権の総数	34,228,198,951口	33,041,891,516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27年11月11日 至 平成28年5月10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等であり、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28年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	4,657,018,751	9,965,350,355
合計	4,657,018,751	9,965,350,355

（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27年5月12日から平成27年11月10日まで、及び平成27年11月11日から平成28年5月10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27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

## （1口当たり情報）

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1617円 (21,617円)	2.5124円 (25,124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	3,000	1,407,000,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	3,000	1,134,000,000	
	森ヒルズリート	15,000	2,517,000,000	
	産業ファンド	100	55,500,000	
	大和ハウスリート	4,100	2,382,100,000	
	アドバンス・レジデンス	7,000	2,037,000,000	
	ケネディクスレジデンシャル	3,500	1,065,750,000	
	A P I 投資法人	4,700	2,824,700,000	
	G L P 投資法人	20,000	2,638,000,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	3,300	817,410,000	
	日本プロロジスリート	12,000	3,088,800,000	
	星野リゾート・リート	700	912,800,000	
	S I A 不動産投資	300	129,450,000	
	イオンリート投資	3,000	427,800,000	
	ヒューリックリート投資法	8,000	1,550,400,000	
	日本リート投資法人	3,500	987,700,000	
	インベスコ・オフィス・Jリート	13,000	1,305,200,000	
	積水ハウス・リート投資	9,000	1,186,200,000	
	ケネディクス商業リート	4,000	1,170,000,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	2,300	252,540,000	
	ジャパン・シニアリビング	1,000	160,900,000	
	野村不動産マスターF	23,000	3,923,800,000	
	いちごホテルリート投資	2,200	398,200,000	
	ラサールロジポート投資	6,000	612,000,000	
	日本ビルファンド	10,100	6,888,200,000	
	ジャパンリアルエステイト	10,000	6,830,000,000	
	日本リテールファンド	19,000	5,141,400,000	
	オリックス不動産投資	14,000	2,608,200,000	
	日本プライムリアルティ	4,500	2,200,500,000	
	プレミア投資法人	7,000	978,600,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	200	89,100,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	20,000	3,732,000,000	
	森トラスト総合リート	6,000	1,289,400,000	
	インヴィンシブル投資法人	27,000	2,119,500,000	
	フロンティア不動産投資	3,900	2,219,100,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	6,800	1,671,440,000	
	福岡リート投資法人	2,500	496,500,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	3,000	1,947,000,000	
	積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	400	46,360,000	
	いちごオフィスリート投資法人	11,000	918,500,000	
	大和証券オフィス投資法人	2,800	1,954,400,000	
	阪急リート投資法人	2,500	344,250,000	
	トップリート投資法人	1,000	412,500,000	
	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	6,200	1,656,020,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,000	2,964,000,000	
	日本賃貸住宅投資法人	16,000	1,382,400,000	
	ジャパンエクセレント投資法人	3,500	547,750,000	
投資証券 合計			81,421,370,000	
合計			81,421,370,000	

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。

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](#)

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	14,112,204	35,883,518
コール・ローン	21,605,140	14,931,268
株式	1,535,001,425	1,385,811,307
ハイブリッド優先証券	505,957,314	455,688,731
投資証券	46,788,428	38,647,621
未収入金	34,943,933	1,606,366
未収配当金	2,948,098	1,891,397
未収利息	948,454	772,942
流動資産合計	2,162,304,996	1,935,233,150
資産合計	2,162,304,996	1,935,233,150
負債の部		
流動負債		
未払金	15,250,971	3,917,071
未払解約金	8,937,000	15,000
その他未払費用	-	35
流動負債合計	24,187,971	3,932,106
負債合計	24,187,971	3,932,106
純資産の部		
元本等		
元本	1 990,229,101	998,308,163
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,147,887,924	932,992,881
元本等合計	2,138,117,025	1,931,301,044
純資産合計	2,138,117,025	1,931,301,044
負債純資産合計	2,162,304,996	1,935,233,150

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) ハイブリッド優先証券</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。</p> <p>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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)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。</p> <p>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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>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>(1)受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)受取利息</p> <p>ハイブリッド優先証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。</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27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1.	1 期首	平成27年5月12日	平成27年11月11日
	期首元本額	1,084,023,763円	990,229,101円
	期中追加設定元本額	71,379,612円	49,931,030円
	期中一部解約元本額	165,174,274円	41,851,968円

期末元本額の内訳 ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	20,706,336円	21,263,834円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	21,406,883円	19,452,058円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	358,479,955円	330,811,575円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	56,694,671円	53,702,526円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	64,281,403円	59,926,796円
米国好配当株オープン（予想分配金提示型）	- 円	513,681円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	78,731,337円	85,901,998円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	155,064,044円	171,911,025円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	234,864,472円	254,824,670円
計	990,229,101円	998,308,163円
2. 期末日における受益権の総数	990,229,101口	998,308,163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27年11月11日 至 平成28年5月10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等であり、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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区分	平成28年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。

(2) コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等  
 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	61,026,489	22,952,917
ハイブリッド優先証券	3,123,200	5,295,770
投資証券	409,760	535,528
合計	64,559,449	17,121,619

(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27年10月16日から平成27年11月10日まで、及び平成28年4月16日から平成28年5月10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27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1592円 (21,592円)	1.9346円 (19,346円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカ・ドル		株	アメリカ・ドル	アメリカ・ドル	
	CALIFORNIA RESOURCES CORP	205	1.630	334.150	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,500	30.410	45,615.000	
	AETNA INC	800	113.930	91,144.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,200	113.160	135,792.000	
	DEVON ENERGY CORP	2,300	30.040	69,092.000	
	ALLIANT ENERGY CORP	1,800	72.940	131,292.000	
	TE CONNECTIVITY LTD	5,300	58.940	312,382.000	
	APPLE INC	5,000	92.790	463,950.000	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	2,600	55.160	143,416.000	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,600	51.080	183,888.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	3,800	61.210	232,598.000	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,700	92.930	157,981.000	
	CMS ENERGY CORP	2,400	41.390	99,336.000	
	CISCO SYSTEMS INC	6,900	26.510	182,919.000	
	BROADCOM LTD	2,100	142.400	299,040.000	
	TIME WARNER INC	2,800	74.160	207,648.000	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	1,500	81.160	121,740.000	
	COSTCO WHOLESALE CORP	400	148.590	59,436.000	
	HANESBRANDS INC	9,000	27.780	250,020.000	
EXPEDIA INC	1,200	112.600	135,120.000		
EXXON MOBIL CORP	3,034	88.570	268,721.380		
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	450	135.930	61,168.500		
FORD MOTOR CO	14,900	13.320	198,468.000		
NEXTERA ENERGY INC	2,262	118.890	268,929.180		

GENERAL ELECTRIC CO	3,000	29.870	89,610.000
GENERAL DYNAMICS CORP	1,400	142.970	200,158.000
ALPHABET INC-CL A	340	729.130	247,904.200
HOME DEPOT INC	1,900	136.240	258,856.000
ASSURANT INC	800	86.070	68,856.000
HUNTINGTON BANCSHARES INC	16,900	9.790	165,451.000
JOHNSON & JOHNSON	2,300	113.720	261,556.000
KROGER CO	3,400	35.840	121,856.000
MONSANTO CO	600	89.030	53,418.000
MERCK & CO. INC.	4,700	54.100	254,270.000
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2,200	75.540	166,188.000
PATTERSON COS INC	3,700	43.540	161,098.000
ALTRIA GROUP INC	4,300	63.660	273,738.000
PFIZER INC	8,700	33.820	294,234.000
PROCTER & GAMBLE CO/THE	2,900	82.120	238,148.000
CONOCOPHILLIPS	3,800	41.650	158,270.000
ACCENTURE PLC-CL A	2,800	115.470	323,316.000
QUALCOMM INC	3,100	51.200	158,720.000
REPUBLIC SERVICES INC	2,700	48.380	130,626.000
ROSS STORES INC	2,800	58.160	162,848.000
CHEVRON CORP	2,000	100.350	200,700.000
SYSCO CORP	2,500	49.720	124,300.000
TRAVELERS COS INC/THE	1,100	110.810	121,891.000
AT&T INC	8,300	38.860	322,538.000
MARATHON PETROLEUM CORP	3,300	34.950	115,335.000
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	1,500	102.690	154,035.000
VALERO ENERGY CORP	800	54.980	43,984.000
ANTHEM INC	1,100	138.440	152,284.000
WALT DISNEY CO/THE	2,400	105.340	252,816.000
WELLS FARGO & CO	4,426	48.880	216,342.880
WAL-MART STORES INC	1,100	68.950	75,845.000
VISA INC-CLASS A SHARES	1,300	78.220	101,686.000
PPG INDUSTRIES INC	600	107.440	64,464.000
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	2,300	84.990	195,477.000
TYSON FOODS INC-CL A	1,900	68.240	129,656.000
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	494	147.460	72,845.240
BANK OF AMERICA CORP	8,900	13.990	124,511.000
ANALOG DEVICES INC	3,300	55.230	182,259.000
AMGEN INC	800	155.410	124,328.000
EATON CORP PLC	3,000	60.660	181,980.000
GILEAD SCIENCES INC	1,000	85.670	85,670.000
CARDINAL HEALTH INC	2,500	78.470	196,175.000
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	4,200	44.170	185,514.000
WW GRAINGER INC	400	230.580	92,232.000
MICROSOFT CORP	4,100	50.070	205,287.000
CVS HEALTH CORP	2,375	105.740	251,132.500
MEDTRONIC PLC	3,216	80.330	258,341.280
BLACKROCK INC	440	355.010	156,204.400
CHUBB LTD	1,800	122.900	221,220.000
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 12,518,204.710 (1,357,724,482)
カナダ・ドル	株	カナダ・ドル	カナダ・ドル
SUNCOR ENERGY INC	4,600	33.240	152,904.000
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	3,000	20.240	60,720.000
MAGNA INTERNATIONAL INC	2,300	53.210	122,383.000
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 336,007.000 (28,086,825)
合計			1,385,811,307



## (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
ハイブリッド優先証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.125 Y	3,200.000	84,608.000	
		CHS INC 7.5 4	4,400.000	122,936.000	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA	4,500.000	118,980.000	
		WINTRUST FINANCIAL CORP 6.5 D	2,700.000	74,979.000	
		FIRST NIAGARA FIN GRP 8.625 B	3,125.000	82,375.000	
		VALLEY NATIONAL BANCORP 6.25 A	2,700.000	74,601.000	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.2 F	1,650.000	44,187.000	
		WELLS FARGO & COMPANY 6 V	1,750.000	46,952.500	
		SOUTHERN CO 6.25	4,100.000	111,807.000	
		AMERICAN FINANCIAL GROUP 6	1,500.000	38,490.000	
		SEASPAN CORPORATION 9.5 C	6,318.000	159,845.400	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.7 W	4,979.000	129,454.000	
		BANK OF AMERICA CORP 6.2 CC	1,957.000	50,705.870	
		CITIGROUP INC 6.3 S	1,800.000	46,656.000	
		FIRST REPUBLIC BANK 5.5 G	2,100.000	53,445.000	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.3 N	3,514.000	92,558.760	
		EBAY INC 6	3,175.000	82,804.000	
		BERKLEY (WR) CORPORATION 5.9 C	2,000.000	51,900.000	
		CHARLES SCHWAB CORP 5.95 D	5,900.000	155,583.000	
		SCE TRUST V 5.45 K	3,375.000	91,597.500	
		BB&T CORPORATION 5.625 H	2,200.000	57,112.000	
		HUNTINGTON BANCSHARES 6.25 D	5,500.000	143,495.000	
		ENTERGY NEW ORLEANS INC 5.5	3,700.000	96,681.000	
		STATE STREET CORP 5.35 G	3,275.000	85,968.750	
		BANK OF AMERICA CORP 6 EE	4,000.000	101,160.000	
		NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.625 H	1,200.000	31,068.000	
		ASPEN INSURANCE HLDG LTD 7.25	700.000	18,550.000	
		BANK OF AMERICA CORP 6.5 Y	3,200.000	85,568.000	
		HANOVER INSURANCE GROUP 6.35	2,100.000	54,747.000	
		ASPEN INSURANCE HLDG LTD 5.95	1,900.000	51,053.000	
		PARTNERRE LTD 7.25 H	3,880.000	108,834.000	
		COUNTRYWIDE CAPITAL IV 6.75	3,550.000	91,590.000	
		WELLS FARGO & COMPANY 8 J	725.000	20,401.500	
		CITIGROUP CAPITAL XIII 7.00835	4,089.000	106,518.450	
		PARTNERRE LTD 6.5 G	3,766.000	99,799.000	
		MORGAN STANLEY 6.875 F	3,900.000	108,537.000	
		ALLY FINANCIAL 6.4022 2/15/40	4,825.000	120,142.500	
		US BANCORP 6.5 F	1,952.000	58,228.160	
		WELLS FARGO & COMPANY 6.625	2,441.000	71,326.020	
		PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P	1,308.000	38,062.800	
		BANK OF AMERICA CORP 6.625 W	2,570.000	69,312.900	
		QWEST CORP 7.375	3,000.000	76,650.000	
		QWEST CORP 7	1,300.000	33,358.000	
		MORGAN STANLEY 6.625 G	1,500.000	40,995.000	
		MORGAN STANLEY 6.375 I	2,125.000	57,035.000	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.85	4,100.000	107,953.000	
		CITIGROUP INC 7.125 J	6,413.000	181,680.290	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.7 T	2,200.000	61,314.000	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.3 W	700.000	18,690.000	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.7 D	2,600.000	71,994.000	
		HARTFORD FINL SVCS GRP 7.875	1,550.000	49,274.500	
		ASTORIA FINANCIAL CORP 6.5 C	6,452.000	169,881.160	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 4,201,445.060	

				(455,688,731)	
ハイブリッド優先証券 合計				455,688,731	[455,688,731]
投資証券	アメリカ・ドル	SUNSTONE HOTEL INVESTORS 6.95 E	2,000	53,600.000	
		RETAIL PROPERTIES OF AME 7 A	2,000	53,940.000	
		CEDAR REALTY TRUST INC 7.25 B	662	17,013.400	
		GRAMERCY PROPERTY TRUST 7.125 A	1,700	45,730.000	
		DDR CORP 6.5 J	1,000	26,340.000	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST 7.75 A	1,110	29,836.800	
		VEREIT INC 6.7 F	3,826	99,246.440	
		VORNADO REALTY TRUST 5.4 L	1,200	30,624.000	
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 356,330.640 (38,647,621)	
投資証券 合計				38,647,621	[38,647,621]
合計				494,336,352	[494,336,352]

ハイブリッド優先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	組入株式 時価比率	組入 ハイブリッ ド優先証券 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	株式 73銘柄	73.3%	24.6%	2.1%	98.5%
	ハイブリッド優先証券 52銘柄				
	投資証券 8銘柄				
カナダ・ドル	株式 3銘柄	100%	-%	-%	1.5%

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](#)

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	67,733,415	58,036,190
コール・ローン	38,358,461	31,322,027
株式	1,391,619,751	1,235,956,671
未収入金	-	9,365,757
未収配当金	1,403,432	4,185,672
流動資産合計	1,499,115,059	1,338,866,317
資産合計	1,499,115,059	1,338,866,317
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	937
未払金	-	19,237,409
未払解約金	2,627,000	1,023,000
その他未払費用	-	102
流動負債合計	2,627,000	20,261,448
負債合計	2,627,000	20,261,448
純資産の部		
元本等		
元本	1	949,233,178
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	547,254,881	353,609,701
元本等合計	1,496,488,059	1,318,604,869
純資産合計	1,496,488,059	1,318,604,869
負債純資産合計	1,499,115,059	1,338,866,317

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金 原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	<p>平成27年5月12日 1,060,125,727円 53,024,557円 163,917,106円</p>	<p>平成27年11月11日 949,233,178円 36,369,177円 20,607,187円</p>
<p>期末元本額の内訳 ファンド名 安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型） インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型） 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型） ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型） DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース） DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース） DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース） 計</p>	<p>26,193,797円 29,009,259円 478,694,856円 76,252,353円 83,809,190円 42,986,493円 84,090,975円 128,196,255円 949,233,178円</p>	<p>29,733,453円 27,712,155円 465,220,656円 76,252,353円 83,856,802円 47,214,298円 94,657,153円 140,348,298円 964,995,168円</p>
2. 期末日における受益権の総数	949,233,178口	964,995,168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27年11月11日 至 平成28年5月10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等であり、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。 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28年5月10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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	61,355,188	29,626,620
合計	61,355,188	29,626,620

（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27年10月16日から平成27年11月10日まで、及び平成28年4月16日から平成28年5月10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27年11月10日 現在				平成28年5月10日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	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	-	-	-	-	9,365,757	-	9,365,757	0	
デンマーク・ クローネ	-	-	-	-	9,365,757	-	9,365,757	0	
買 建	-	-	-	-	9,365,757	-	9,364,820	937	
ユーロ	-	-	-	-	9,365,757	-	9,364,820	937	
合計	-	-	-	-	18,731,514	-	18,730,577	937	

## (注) 1. 時価の算定方法

(1) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

期末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5765円 (15,765円)	1.3664円 (13,664円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
イギリス・ボンド		株	イギリス・ボンド	イギリス・ボンド	
	REXAM PLC	29,192	6.285	183,471.720	
	PRUDENTIAL PLC	14,844	13.010	193,120.440	
	AVIVA PLC	40,669	4.264	173,412.610	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	15,900	14.650	232,935.000	
	VODAFONE GROUP PLC	90,005	2.189	197,020.940	
	KINGFISHER PLC	44,504	3.631	161,594.020	
	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	3,420	68.370	233,825.400	
	NATIONAL GRID PLC	22,159	10.015	221,922.380	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	7,264	42.135	306,068.640	
	HSBC HOLDINGS PLC	52,046	4.298	223,693.700	
	CARNIVAL PLC	3,569	35.310	126,021.390	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	11,761	17.030	200,289.830	
イギリス・ボンド 小計				イギリス・ボンド 2,453,376.070 (383,364,545)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	

	NESTLE SA-REG	7,685	71.450	549,093.250
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,005	211.200	212,256.000
	NOVARTIS AG-REG	5,611	72.050	404,272.550
	GIVAUDAN-REG	138	1,919.000	264,822.000
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 1,430,443.800 (159,780,572)
スウェーデン・クローナ	株		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ
	SWEDBANK AB - A SHARES	12,350	172.500	2,130,375.000
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	6,378	272.700	1,739,280.600
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	10,734	253.700	2,723,215.800
	ATLAS COPCO AB-B SHS	10,292	186.000	1,914,312.000
スウェーデン・クローナ	小計			スウェーデン・クローナ 8,507,183.400 (112,975,395)
デンマーク・クローネ	株		デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ
	TDC A/S	23,970	34.100	817,377.000
デンマーク・クローネ	小計			デンマーク・クローネ 817,377.000 (13,568,459)
ノルウェー・クローネ	株		ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ
	DNB ASA	14,281	98.800	1,410,962.800
ノルウェー・クローネ	小計			ノルウェー・クローネ 1,410,962.800 (18,610,599)
ユーロ	株		ユーロ	ユーロ
	BAYER AG-REG	2,789	99.950	278,760.550
	SIEMENS AG-REG	2,489	93.030	231,551.670
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,083	76.520	159,391.160
	BASF SE	3,829	68.780	263,358.620
	ALLIANZ SE-REG	1,541	140.900	217,126.900
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	21,145	15.435	326,373.070
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	10,209	23.200	236,848.800
	KONINKLIJKE AHOLD NV	11,875	19.255	228,653.120
	KONINKLIJKE DSM NV	4,772	51.640	246,426.080
	KONINKLIJKE KPN NV	60,281	3.409	205,497.920
	ASML HOLDING NV	1,791	81.250	145,518.750
	TOTAL SA	6,299	42.080	265,061.920
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	4,676	53.840	251,755.840
	BNP PARIBAS	5,987	44.150	264,326.050
	CAPGEMINI	2,183	81.130	177,106.790
	SANOFI	4,064	71.810	291,835.840
	ENI SPA	10,824	13.380	144,825.120
	ENAGAS SA	10,115	26.665	269,716.470
	OESTERREICHISCHE POST AG	1,912	33.740	64,510.880
	CTT-CORREIOS DE PORTUGAL	20,773	8.000	166,184.000
ユーロ	小計			ユーロ 4,434,829.550 (547,657,101)
合計				1,235,956,671 [1,235,956,671]

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

(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	組入株式 時価比率	合計金額に 対する比率
イギリス・ポンド	株式 12銘柄	100%	31.0%
スイス・フラン	株式 4銘柄	100%	12.9%
スウェーデン・クローナ	株式 4銘柄	100%	9.1%
デンマーク・クローネ	株式 1銘柄	100%	1.1%
ノルウェー・クローネ	株式 1銘柄	100%	1.5%
ユーロ	株式 20銘柄	100%	44.4%

### 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](#)



## 「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	102,536,377	68,829,709
コール・ローン	9,986,708	17,469,927
株式	971,283,991	852,692,106
投資信託受益証券	-	12,057,507
投資証券	-	25,324,200
未収入金	53,926,547	25,408,519
未収配当金	928,279	532,604
流動資産合計	1,138,661,902	1,002,314,572
資産合計	1,138,661,902	1,002,314,572
負債の部		
流動負債		
未払金	22,117,994	26,359,199
未払解約金	6,000	1,000,000
その他未払費用	-	12
流動負債合計	22,123,994	27,359,211
負債合計	22,123,994	27,359,211
純資産の部		
元本等		
元本	1	579,691,017
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		536,846,891
元本等合計		1,116,537,908
純資産合計		1,116,537,908
負債純資産合計		1,002,314,572

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2) 投資信託受益証券</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。</p> <p>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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)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。</p> <p>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>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</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27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1.	1 期首	平成27年5月12日	平成27年11月11日
	期首元本額	660,539,783円	579,691,017円
	期中追加設定元本額	13,291,164円	11,310,368円
	期中一部解約元本額	94,139,930円	21,582,499円
	期末元本額の内訳 ファンド名		

安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	21,285,343円	22,958,417円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	23,354,664円	21,724,088円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	375,493,723円	362,637,468円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	59,880,269円	58,792,780円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	65,607,238円	65,118,815円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	5,714,908円	6,359,084円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	11,182,641円	12,765,761円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	17,172,231円	19,062,473円
計	579,691,017円	569,418,886円
2. 期末日における受益権の総数	579,691,017口	569,418,886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27年11月11日 至 平成28年5月10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等であり、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。 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。

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成28年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	1,786,202	7,368,008
投資信託受益証券	-	867,537
投資証券	-	1,255,320
合計	1,786,202	6,980,225

（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27年10月16日から平成27年11月10日まで、及び平成28年4月16日から平成28年5月10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27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.9261円 (19,261円)	1.7122円 (17,122円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	BHP BILLITON LIMITED	9,000	18.410	165,690.000	
	SOUTH32 LTD	13,000	1.640	21,320.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	7,000	27.340	191,380.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	10,400	28.450	295,880.000	
	CYBG PLC - CDI	5,100	4.260	21,726.000	
	WESTPAC BANKING CORP	9,000	31.110	279,990.000	
	RIO TINTO LTD	2,000	46.740	93,480.000	
	AMCOR LIMITED	38,000	15.880	603,440.000	
	SG FLEET GROUP LTD	56,000	3.830	214,480.000	
	BWX LTD	21,000	4.850	101,850.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	13,000	10.230	132,990.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	6,673	75.780	505,679.940	
	TELSTRA CORP LTD	36,000	5.630	202,680.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	4,450	67.000	298,150.000	
	WESFARMERS LTD	8,000	43.160	345,280.000	
	ASX LTD	4,600	44.650	205,390.000	
COMPUTERSHARE LTD	14,000	10.280	143,920.000		
TRANSURBAN GROUP	30,000	12.370	371,100.000		
DUET GROUP	60,315	2.310	139,327.650		
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 4,333,753.590 (343,233,284)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	14,500	14.910	216,195.000	
	SHENG SIONG GROUP LTD	180,000	0.900	162,000.000	
	INNOVALUES LTD	200,000	0.940	188,000.000	
MM2 ASIA LTD	210,000	0.540	113,400.000		

	FIRST RESOURCES LTD	138,000	1.685	232,530.000	
	ROTARY ENGINEERING LTD	44,000	0.375	16,500.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 928,625.000 (73,435,665)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	KIA MOTORS CORP	2,400	46,200.000	110,880,000.000	
	POSCO	780	208,500.000	162,630,000.000	
	MEDY-TOX INC	200	469,600.000	93,920,000.000	
	CROWN CONFECTIONERY CO LTD	280	495,000.000	138,600,000.000	
	BINEX CO LTD	8,000	18,100.000	144,800,000.000	
	HUONS GLOBAL CO LTD	1,300	80,900.000	105,170,000.000	
	LOEN ENTERTAINMENT INC	1,700	80,000.000	136,000,000.000	
	DUK SAN NEOLUX CO LTD	3,200	26,700.000	85,440,000.000	
	HANMI PHARM CO LTD	110	574,000.000	63,140,000.000	
	LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	380	1,047,000.000	397,860,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	300	1,299,000.000	389,700,000.000	
	LG LIFE SCIENCES LTD	1,200	67,400.000	80,880,000.000	
	MACQUARIE KOREA INFRA FUND	29,377	8,490.000	249,410,730.000	
	AMOREPACIFIC CORP	520	431,000.000	224,120,000.000	
韓国・ウォン 小計				韓国・ウォン 2,382,550,730.000 (220,385,943)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CLP HOLDINGS LTD	15,000	72.850	1,092,750.000	
	TENCENT HOLDINGS LTD	6,000	155.100	930,600.000	
	HUANENG POWER INTL INC-H	140,000	5.470	765,800.000	
	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	200,000	4.740	948,000.000	
	BEST PACIFIC INTERNATIONAL H	106,000	4.690	497,140.000	
	AIA GROUP LTD	15,000	44.550	668,250.000	
	GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	100,000	5.600	560,000.000	
	YESTAR INTERNATIONAL HOLDING	579,000	3.080	1,783,320.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 7,245,860.000 (101,224,664)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	LAND MARK OPTOELECTRONICS	7,000	453.500	3,174,500.000	
	NAN YA PLASTICS CORP	41,000	61.500	2,521,500.000	
	HOTA INDUSTRIAL MFG CO LTD	23,000	141.500	3,254,500.000	
	MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	180,000	22.900	4,122,000.000	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	42,000	58.000	2,436,000.000	
	TUNG THIH ELECTRONIC CO LTD	7,000	432.000	3,024,000.000	
	ENNOCONN CORP	9,000	424.500	3,820,500.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	80,000	147.500	11,800,000.000	
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 34,153,000.000 (114,412,550)	
合計				852,692,106 [852,692,106]	

## (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	香港・ドル	ISHARES FTSE A50 CHINA INDEX	90,000.000	863,100.000	
	香港・ドル 小計			香港・ドル 863,100.000 (12,057,507)	
投資信託受益証券 合計				12,057,507 [12,057,507]	

投資証券	オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
		SCENTRE GROUP	30,000	139,500.000	
	GOODMAN GROUP	25,000	180,250.000		
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル	
				319,750.000	
				(25,324,200)	
投資証券 合計				25,324,200	
				[25,324,200]	
合計				37,381,707	
				[37,381,707]	

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	組入株式 時価比率	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
オーストラリア・ドル	株式 19銘柄 投資証券 2銘柄	93.1%	-%	6.9%	41.3%
シンガポール・ドル	株式 6銘柄	100%	-%	-%	8.3%
韓国・ウォン	株式 14銘柄	100%	-%	-%	24.8%
香港・ドル	株式 8銘柄 投資信託 受益証券 1銘柄	89.4%	10.6%	-%	12.7%
台湾・ドル	株式 8銘柄	100%	-%	-%	12.9%

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。

[次へ](#)

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況  
以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	903,838,172	2,468,250,771
株式	52,205,748,900	36,889,827,770
投資証券	2,692,474,000	2,072,467,800
派生商品評価勘定	-	2,270,681
未収入金	2,290,009,666	323,584,155
未収配当金	427,410,240	466,363,293
前払金	-	36,600,000
差入委託証拠金	-	70,500,000
流動資産合計	58,519,480,978	42,329,864,470
資産合計	58,519,480,978	42,329,864,470
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	6,505,166
未払金	87,296,253	235,661,111
未払解約金	857,000,000	224,000,000
その他未払費用	-	6,646
流動負債合計	944,296,253	466,172,923
負債合計	944,296,253	466,172,923
純資産の部		
元本等		
元本	1 22,847,290,046	18,896,749,108
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	34,727,894,679	22,966,942,439
元本等合計	57,575,184,725	41,863,691,547
純資産合計	57,575,184,725	41,863,691,547
負債純資産合計	58,519,480,978	42,329,864,470

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式</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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</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。</p> <p>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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>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。</p> <p>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>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び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。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1. 1 期首	平成27年5月12日	平成27年11月11日
期首元本額	28,390,753,089円	22,847,290,046円
期中追加設定元本額	5,096,394,196円	3,259,583,391円
期中一部解約元本額	10,639,857,239円	7,210,124,329円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ好配当日本株投信Q (FOFs用)(適格機関投資家専用)	9,107,610,635円	3,379,531,315円
ダイワ好配当日本株投信(季節 点描)	11,777,618,040円	13,524,463,226円
ダイワ・バランス3資産(外 債・海外リート・好配当日本 株)	45,874,440円	44,515,728円
安定重視ポートフォリオ(奇数 月分配型)	52,380,043円	56,481,381円
インカム重視ポートフォリオ (奇数月分配型)	55,054,477円	53,217,252円
成長重視ポートフォリオ(奇数 月分配型)	912,844,208円	874,864,411円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	148,518,048円	144,335,816円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	162,454,284円	156,848,423円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	97,297,224円	111,131,371円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	193,605,716円	222,257,391円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	294,032,931円	329,102,794円
計	22,847,290,046円	18,896,749,108円
2. 期末日における受益権の総数	22,847,290,046口	18,896,749,108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27年11月11日 至 平成28年5月10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等であり、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（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。
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28年5月10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等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
株式	1,761,589,760	213,916,043
投資証券	227,215,584	31,524,606
合計	1,988,805,344	182,391,437

（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27年10月16日から平成27年11月10日まで、及び平成28年4月16日から平成28年5月10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

	平成27年11月10日 現在	平成28年5月10日 現在

種 類	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)		時価 (円)	評価損益 (円)
		うち 1年超				うち 1年超		
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	-	-	-	-	1,501,350,000	-	1,497,500,000	3,850,000
合計	-	-	-	-	1,501,350,000	-	1,497,500,000	3,850,000

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.5200円 (25,200円)	2.2154円 (22,154円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

銘 柄	株 式 数	評価額(円)		備考
		単 価	金 額	
北弘電社	95,000	346.00	32,870,000	
田辺工業	26,500	796.00	21,094,000	
名工建設	165,000	790.00	130,350,000	
大東建託	35,400	16,585.00	587,109,000	
東洋建設	383,900	483.00	185,423,700	
日成ビルド工業	759,000	434.00	329,406,000	
大和ハウス	119,100	3,033.00	361,230,300	
九電工	90,000	3,250.00	292,500,000	
トラスト・テック	343,000	1,368.00	469,224,000	
S Foods	41,000	2,894.00	118,654,000	
システナ	14,300	1,802.00	25,768,600	
新日鉄住金SOL	144,200	1,745.00	251,629,000	
麒麟HD	250,000	1,784.00	446,000,000	
ローソン	45,000	8,710.00	391,950,000	
ハニーズ	140,700	1,164.00	163,774,800	
横浜冷凍	222,700	1,085.00	241,629,500	
日本たばこ産業	90,000	4,593.00	413,370,000	
アルコニックス	130,300	1,563.00	203,658,900	
あい ホールディングス	54,900	3,290.00	180,621,000	
トヨタ紡織	40,000	2,241.00	89,640,000	
すかいらく	210,000	1,356.00	284,760,000	
アーバネットコーポレーション	371,000	336.00	124,656,000	
サムティ	266,300	1,139.00	303,315,700	
ユニゾホールディングス	68,800	5,590.00	384,592,000	
サンセイランディック	261,400	970.00	253,558,000	

日本調剤	25,700	3,915.00	100,615,500
帝人	452,000	367.00	165,884,000
ケー・エフ・シー	77,600	1,890.00	146,664,000
SUMCO	400,000	716.00	286,400,000
共和レザー	37,800	822.00	31,071,600
SRAホールディングス	133,900	2,546.00	340,909,400
アバント	6,300	1,061.00	6,684,300
王子ホールディングス	600,000	436.00	261,600,000
神島化学	110,000	571.00	62,810,000
関東電化	505,000	774.00	390,870,000
デンカ	354,000	458.00	162,132,000
協和発酵キリン	96,000	2,026.00	194,496,000
宇部興産	811,000	217.00	175,987,000
日立化成	120,000	1,970.00	236,400,000
日本エス・エイチ・エル	17,400	2,717.00	47,275,800
扶桑化学工業	173,400	1,698.00	294,433,200
花王	80,000	6,102.00	488,160,000
エーザイ	32,000	6,640.00	212,480,000
小野薬品	106,000	5,210.00	552,260,000
ダイト	34,400	2,910.00	100,104,000
大日本塗料	790,000	196.00	154,840,000
日本特殊塗料	75,000	866.00	64,950,000
DIC	371,000	252.00	93,492,000
フューチャー	20,100	733.00	14,733,300
大塚商会	25,800	5,500.00	141,900,000
日本ハウズイング	20,600	3,365.00	69,319,000
ポーラ・オルビスHD	55,500	9,320.00	517,260,000
東燃ゼネラル石油	198,000	996.00	197,208,000
出光興産	120,000	2,263.00	271,560,000
ブリヂストン	100,000	4,138.00	413,800,000
住友ゴム	260,000	1,717.00	446,420,000
ノザワ	477,000	419.00	199,863,000
JFEホールディングス	200,000	1,464.00	292,800,000
日新製鋼	230,000	1,474.00	339,020,000
山陽特殊製鋼	251,000	458.00	114,958,000
日本軽金属HD	1,530,000	191.00	292,230,000
東邦亜鉛	417,000	285.00	118,845,000
古河機金	67,000	161.00	10,787,000
UACJ	1,228,000	215.00	264,020,000
東プレ	36,300	2,197.00	79,751,100
東京製綱	789,000	147.00	115,983,000
タクマ	38,000	921.00	34,998,000
テクノプロ・ホールディング	210,400	3,175.00	668,020,000
ジャパンマテリアル	92,800	2,802.00	260,025,600
日進工具	35,000	1,850.00	64,750,000
日本郵政	61,300	1,436.00	88,026,800
ベルシステム24HLDGS	195,100	967.00	188,661,700
三精テクノロジーズ	51,400	600.00	30,840,000
西島製作所	118,400	1,050.00	124,320,000
千代田化工建	300,000	827.00	248,100,000
愛知電機	501,000	328.00	164,328,000
日新電機	169,000	1,178.00	199,082,000
能美防災	111,600	1,414.00	157,802,400
ホーチキ	114,300	1,266.00	144,703,800
TDK	18,900	5,940.00	112,266,000

スミダコーポレーション	150,000	674.00	101,100,000
リオン	118,000	1,695.00	200,010,000
村田製作所	22,500	12,880.00	289,800,000
I H I	1,300,000	237.00	308,100,000
ゆうちょ銀行	172,900	1,325.00	229,092,500
日産自動車	900,700	1,004.00	904,302,800
トヨタ自動車	94,400	5,677.00	535,908,800
カルソニックカンセイ	220,000	783.00	172,260,000
富士重工業	70,800	3,743.00	265,004,400
ノジマ	99,200	1,357.00	134,614,400
アドヴァン	123,500	1,057.00	130,539,500
萩原電気	111,100	1,947.00	216,311,700
丸文	284,200	652.00	185,298,400
日本ライフライン	138,600	3,030.00	419,958,000
キヤノン	100,000	3,075.00	307,500,000
S H O E I	85,800	1,610.00	138,138,000
桑山	77,700	446.00	34,654,200
大日本印刷	300,000	1,027.00	308,100,000
ニチハ	84,200	1,656.00	139,435,200
ピジョン	64,700	2,901.00	187,694,700
天馬	74,500	1,699.00	126,575,500
岡村製作所	152,000	1,011.00	153,672,000
伊藤忠	505,800	1,382.00	699,015,600
三井物産	300,000	1,284.50	385,350,000
三菱商事	160,000	1,798.00	287,680,000
フルサト工業	86,100	1,483.00	127,686,300
稲畑産業	162,400	1,078.00	175,067,200
伊藤忠エネクス	124,500	949.00	118,150,500
加賀電子	158,500	1,328.00	210,488,000
大塚家具	73,700	1,223.00	90,135,100
あおぞら銀行	2,290,000	389.00	890,810,000
三菱UFJフィナンシャルG	1,873,000	508.80	952,982,400
三井住友フィナンシャルG	244,300	3,358.00	820,359,400
みずほフィナンシャルG	2,631,900	165.80	436,369,020
オリックス	243,000	1,600.50	388,921,500
三菱UFJリース	120,000	468.00	56,160,000
M S & A D	145,500	2,959.50	430,607,250
第一生命	196,600	1,343.00	264,033,800
東京海上HD	100,000	3,713.00	371,300,000
スターツコーポレーション	106,500	2,182.00	232,383,000
タカラレーベン	389,800	754.00	293,909,200
シノケングループ	199,500	2,364.00	471,618,000
西日本旅客鉄道	60,000	6,668.00	400,080,000
東海旅客鉄道	5,100	19,450.00	99,195,000
センコー	203,000	686.00	139,258,000
日本航空	196,400	4,044.00	794,241,600
日本コンセプト	80,900	787.00	63,668,300
スカパーJ S A T H D	500,000	618.00	309,000,000
日本電信電話	241,600	5,033.00	1,215,972,800
沖縄セルラー電話	14,600	2,997.00	43,756,200
N T T ドコモ	300,000	2,800.00	840,000,000
中国電力	320,000	1,421.00	454,720,000
電源開発	100,000	3,105.00	310,500,000
スクウェア・エニックス・HD	66,300	2,801.00	185,706,300
シーイーシー	163,200	1,604.00	261,772,800

SCSK	20,600	4,020.00	82,812,000	
セコム	30,000	8,484.00	254,520,000	
日鉄住金物産	707,000	383.00	270,781,000	
パーカーコーポレーション	506,000	288.00	145,728,000	
東テク	277,600	960.00	266,496,000	
ジェコス	267,600	1,184.00	316,838,400	
合計			36,889,827,770	

## (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	MCUBS MidCity投資法人	2,131	805,518,000	
	大和ハウスリート	315	183,015,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	10,971	1,083,934,800	
投資証券 合計			2,072,467,800	
合計			2,072,467,800	

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。

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。

## インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(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) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成27年11月11日から平成28年5月10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

#### 【インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

## (1) 【貸借対照表】

	前 期		当 期	
	平成27年11月10日現在		平成28年5月10日現在	
	金 額 (円)		金 額 (円)	
資産の部				
流動資産				
コール・ローン		18,218,839		16,783,274
親投資信託受益証券		1,366,562,764		1,173,139,582
流動資産合計		1,384,781,603		1,189,922,856
資産合計		1,384,781,603		1,189,922,856
負債の部				
流動負債				
未払収益分配金		3,810,402		3,529,714
未払解約金		186,557		787,276
未払受託者報酬		124,993		109,375
未払委託者報酬		3,062,705		2,680,088
その他未払費用		58,795		51,080
流動負債合計		7,243,452		7,157,533
負債合計		7,243,452		7,157,533
純資産の部				
元本等				
元本	1	1,524,161,118		1,411,885,690
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	2	146,622,967		229,120,367
( 分配準備積立金 )		8,707,914		5,178,248
元本等合計		1,377,538,151		1,182,765,323
純資産合計		1,377,538,151		1,182,765,323
負債純資産合計		1,384,781,603		1,189,922,856

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 平成27年5月12日 至 平成27年11月10日 金 額 ( 円 )	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日 金 額 ( 円 )
営業収益		
受取利息	4,505	2,326
有価証券売買等損益	40,129,409	76,423,182
営業収益合計	40,124,904	76,420,856
営業費用		
支払利息	-	442
受託者報酬	392,520	340,918
委託者報酬	1 9,617,862	8,353,506
その他費用	58,795	51,080
営業費用合計	10,069,177	8,745,946
営業損失 ( )	50,194,081	85,166,802
経常損失 ( )	50,194,081	85,166,802
当期純損失 ( )	50,194,081	85,166,802
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	1,421,075	143,490
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	89,990,897	146,622,967
剰余金増加額又は欠損金減少額	13,105,030	17,122,005
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	13,105,030	17,122,005
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,380,672	3,486,075
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	3,380,672	3,486,075
分配金	2 14,741,272	10,823,038
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	146,622,967	229,120,367



## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 平成27年11月11日	至 平成28年5月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1. 1 期首元本額	1,656,226,758円	1,524,161,118円
期中追加設定元本額	46,300,831円	24,051,624円
期中一部解約元本額	178,366,471円	136,327,052円
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,524,161,118口	1,411,885,690口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は146,622,967円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は229,120,367円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成27年5月12日 至 平成27年11月10日	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	397,585円	341,239円
2. 2 分配金の計算過程	（自平成27年5月12日 至平成27年7月10日） 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（3,484,717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（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（865,381円）及び分配準備積立金（11,891,812円）より分配対象額は16,241,910円（1万口当たり103.23円）であり、うち5,506,585円（1万口当たり35円）を分配金額としております。	（自平成27年11月11日 至平成28年1月12日） 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（1,974,418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（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（358,628円）及び分配準備積立金（8,358,922円）より分配対象額は10,691,968円（1万口当たり72.99円）であり、うち3,662,333円（1万口当たり25円）を分配金額としております。

<p>(自平成27年7月11日 至平成27年9月10日)</p> <p>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(2,936,032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(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(1,125,336円)及び分配準備積立金(9,481,685円)より分配対象額は13,543,053円(1万口当たり87.39円)であり、うち5,424,285円(1万口当たり35円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成27年9月11日 至平成27年11月10日)</p> <p>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(4,892,837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(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(360,930円)及び分配準備積立金(7,625,479円)より分配対象額は12,879,246円(1万口当たり84.50円)であり、うち3,810,402円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成28年1月13日 至平成28年3月10日)</p> <p>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(2,474,471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(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(440,416円)及び分配準備積立金(6,538,393円)より分配対象額は9,453,280円(1万口当たり65.09円)であり、うち3,630,991円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>
<p>(自平成27年9月11日 至平成27年11月10日)</p> <p>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(4,892,837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(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(360,930円)及び分配準備積立金(7,625,479円)より分配対象額は12,879,246円(1万口当たり84.50円)であり、うち3,810,402円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成28年3月11日 至平成28年5月10日)</p> <p>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(3,495,832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(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(454,087円)及び分配準備積立金(5,212,130円)より分配対象額は9,162,049円(1万口当たり64.89円)であり、うち3,529,714円(1万口当たり25円)を分配金額としております。</p>	

## (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	当 期 自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10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等であり、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	当 期 平成28年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	前 期 平成27年11月10日現在	当 期 平成28年5月10日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	26,462,843	8,130,721
合計	26,462,843	8,130,721

## (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

前 期 平成27年11月10日現在	当 期 平成28年5月10日現在
該当事項はありません。	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)

当 期 自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10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なわれていないため、該当事項はありません。

## (1口当たり情報)

	前 期 平成27年11月10日現在	当 期 平成28年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9038円 (9,038円)	0.8377円 (8,377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	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	514,618,965	823,544,729	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	29,985,804	59,842,669	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	53,217,252	117,897,500	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	19,452,058	37,631,951	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	27,712,155	37,865,888	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	21,724,088	37,195,983	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	23,547,549	59,160,862	
親投資信託受益証券 合計			1,173,139,582	
合計			1,173,139,582	

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、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」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、当ファンドの特定期間末日（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。

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

## 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

(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) 当ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成27年11月11日から平成28年5月10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

#### 【成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

## (1) 【貸借対照表】

	前 期		当 期	
	平成27年11月10日現在		平成28年5月10日現在	
	金 額 (円)		金 額 (円)	
資産の部				
流動資産				
コール・ローン		93,032,191		84,575,197
親投資信託受益証券		6,478,752,895		5,506,730,218
未収入金		12,000,000		8,000,000
流動資産合計		6,583,785,086		5,599,305,415
資産合計		6,583,785,086		5,599,305,415
負債の部				
流動負債				
未払収益分配金		26,872,485		25,554,913
未払解約金		8,060,364		8,676,966
未払受託者報酬		582,380		510,774
未払委託者報酬		15,142,176		13,280,473
その他未払費用		279,187		238,162
流動負債合計		50,936,592		48,261,288
負債合計		50,936,592		48,261,288
純資産の部				
元本等				
元本	1	6,718,121,269		6,388,728,449
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	2	185,272,775		837,684,322
( 分配準備積立金 )		364,464,795		307,934,619
元本等合計		6,532,848,494		5,551,044,127
純資産合計		6,532,848,494		5,551,044,127
負債純資産合計		6,583,785,086		5,599,305,415

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 平成27年5月12日 至 平成27年11月10日 金 額 ( 円 )	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日 金 額 ( 円 )
営業収益		
受取利息	22,676	10,436
有価証券売買等損益	185,638,032	555,022,677
営業収益合計	185,615,356	555,012,241
営業費用		
支払利息	-	2,020
受託者報酬	1,861,827	1,587,499
委託者報酬	48,408,404	41,276,248
その他費用	279,187	238,162
営業費用合計	50,549,418	43,103,929
営業損失 ( )	236,164,774	598,116,170
経常損失 ( )	236,164,774	598,116,170
当期純損失 ( )	236,164,774	598,116,170
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )	9,145,710	990,394
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	135,442,808	185,272,775
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,722,180	24,546,273
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	5,243,936	24,546,273
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	1,478,244	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	2,286,837
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	-	2,286,837
分配金	82,127,279	77,545,207
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	185,272,775	837,684,322

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 平成27年11月11日	至 平成28年5月10日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券  移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成27年11月10日現在	平成28年5月10日現在
1. 1 期首元本額	7,090,045,256円	6,718,121,269円
期中追加設定元本額	80,486,286円	25,129,059円
期中一部解約元本額	452,410,273円	354,521,879円
2. 特定期間末日における受益権の総数	6,718,121,269口	6,388,728,449口
3. 2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は185,272,775円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は837,684,322円であります。

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成27年5月12日 至 平成27年11月10日	自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10日
1. 1 投資信託財産（親投資信託）の運用の指図に係る権限の全部または一部を委託するために要する費用	4,781,510円	4,052,965円
2. 2 分配金の計算過程	（自平成27年5月12日 至平成27年7月10日） 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（19,027,367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（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,330,980円）及び分配準備積立金（406,747,387円）より分配対象額は429,105,734円（1万口当たり613.54円）であり、うち27,975,668円（1万口当たり40円）を分配金額としております。	（自平成27年11月11日 至平成28年1月12日） 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（5,640,252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（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（5,148,257円）及び分配準備積立金（354,280,505円）より分配対象額は365,069,014円（1万口当たり558.31円）であり、うち26,155,491円（1万口当たり40円）を分配金額としております。



<p>(自平成27年7月11日 至平成27年9月10日)</p> <p>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(9,580,304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(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,453,502円)及び分配準備積立金(386,703,721円)より分配対象額は400,737,527円(1万口当たり587.61円)であり、うち27,279,126円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成27年9月11日 至平成27年11月10日)</p> <p>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(28,240,124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(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,807,432円)及び分配準備積立金(363,097,156円)より分配対象額は396,144,712円(1万口当たり589.67円)であり、うち26,872,485円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成28年1月13日 至平成28年3月10日)</p> <p>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(6,822,425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(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,550,375円)及び分配準備積立金(329,213,641円)より分配対象額は341,586,441円(1万口当たり528.88円)であり、うち25,834,803円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>
<p>(自平成27年9月11日 至平成27年11月10日)</p> <p>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(28,240,124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(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,807,432円)及び分配準備積立金(363,097,156円)より分配対象額は396,144,712円(1万口当たり589.67円)であり、うち26,872,485円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成28年3月11日 至平成28年5月10日)</p> <p>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(27,004,887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(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,866,997円)及び分配準備積立金(306,484,645円)より分配対象額は339,356,529円(1万口当たり531.18円)であり、うち25,554,913円(1万口当たり40円)を分配金額としております。</p>	

## (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	当 期 自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10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等であり、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	当 期 平成28年5月10日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。  (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	前 期 平成27年11月10日現在	当 期 平成28年5月10日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	273,655,154	2,895,359
合計	273,655,154	2,895,359

## (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

前 期 平成27年11月10日現在	当 期 平成28年5月10日現在
該当事項はありません。	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)

当 期 自 平成27年11月11日 至 平成28年5月10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)

	前 期 平成27年11月10日現在	当 期 平成28年5月10日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9724円 (9,724円)	0.8689円 (8,689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	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	692,740,491	1,108,592,607	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	141,667,549	282,725,927	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	874,864,411	1,938,174,616	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	330,811,575	639,988,072	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	465,220,656	635,677,504	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	362,637,468	620,907,872	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	111,711,360	280,663,620	
親投資信託受益証券 合計			5,506,730,218	
合計			5,506,730,218	

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、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」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、当ファンドの特定期間末日(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。

#### 「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

#### 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

#### 「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

#### 「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

#### 「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

#### 「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

#### 「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

## 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>

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

【純資産額計算書】

平成28年5月31日

資産総額	1,272,024,433円
負債総額	8,437,085円
純資産総額（ - ）	1,263,587,348円
発行済数量	1,387,126,673口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9109円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

純資産額計算書

平成28年5月31日

資産総額	43,146,767,444円
負債総額	3,390,958,552円
純資産総額（ - ）	39,755,808,892円
発行済数量	24,506,479,299口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.6223円

(参考) ダイワ日本国債マザーファンド

純資産額計算書

平成28年5月31日

資産総額	422,480,112,705円
負債総額	8,598,893円
純資産総額（ - ）	422,471,513,812円
発行済数量	333,678,890,580口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2661円

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

純資産額計算書

平成28年5月31日

資産総額	139,186,430,444円
負債総額	168,430,404円
純資産総額（ - ）	139,018,000,040円
発行済数量	69,299,905,430口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.0060円

## (参考) ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年5月31日

資産総額	81,393,228,856円
負債総額	90,747,020円
純資産総額（ - ）	81,302,481,836円
発行済数量	33,151,437,313口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.4525円

## (参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年5月31日

資産総額	2,047,038,849円
負債総額	40,865,454円
純資産総額（ - ）	2,006,173,395円
発行済数量	995,234,944口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.0158円

## (参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年5月31日

資産総額	1,390,827,918円
負債総額	6,110,102円
純資産総額（ - ）	1,384,717,816円
発行済数量	961,522,732口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.4401円

## (参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年5月31日

資産総額	1,016,144,643円
負債総額	12円
純資産総額( - )	1,016,144,631円
発行済数量	573,626,243口
1単位当たり純資産額( / )	1.7714円

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

## 純資産額計算書

平成28年5月31日

資産総額	43,021,510,360円
負債総額	302,031,973円
純資産総額( - )	42,719,478,387円
発行済数量	18,789,490,342口
1単位当たり純資産額( / )	2.2736円

インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)

## 純資産額計算書

平成28年5月31日

資産総額	1,200,857,855円
負債総額	946,176円
純資産総額( - )	1,199,911,679円
発行済数量	1,411,796,694口
1単位当たり純資産額( / )	0.8499円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」の記載と同じ。

(参考) ダイワJ - REITアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

(参考) ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

### 成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

#### 純資産額計算書

平成28年5月31日

資産総額	5,667,568,314円
負債総額	13,833,585円
純資産総額（ - ）	5,653,734,729円
発行済数量	6,347,971,983口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8906円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ北米好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ欧州好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。

（参考）ダイワ好配当日本株マザーファンド

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」の記載と同じ。



## 第三部 【委託会社等の情報】

### 第1 【委託会社等の概況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 1 委託会社等の概況 および2 事業の内容及び営業の概況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

#### 1 【委託会社等の概況】

##### a. 資本金の額

平成28年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年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

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

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

投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議

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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

平成28年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	44	176,579
追加型株式投資信託	633	11,647,845
株式投資信託 合計	677	11,824,424
単位型公社債投資信託	7	64,829
追加型公社債投資信託	17	2,443,770
公社債投資信託 合計	24	2,508,598
総合計	701	14,333,022

## 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。
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27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,438	31,715
有価証券	4,878	1,137
前払費用	139	159
未収委託者報酬	10,295	9,896
未収収益	110	87
繰延税金資産	585	468
その他	153	83
流動資産計	47,600	43,547
固定資産		
有形固定資産	1 255	1 243
建物	21	18
器具備品	234	224
無形固定資産	2,759	2,706
ソフトウェア	2,758	2,385
ソフトウェア仮勘定	1	321
投資その他の資産	12,979	14,223
投資有価証券	6,667	7,872
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	124	123
長期差入保証金	996	1,049

その他	60	47
固定資産計	15,995	17,173
資産合計	63,596	60,720

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	64	61
未払金	9,172	8,789
未払収益分配金	5	5
未払償還金	72	63
未払手数料	4,965	4,330
その他未払金	2	2
未払費用	4,162	4,215
未払法人税等	1,133	1,155
未払消費税等	1,429	538
賞与引当金	1,092	937
その他	747	22
流動負債計	17,801	15,720
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,072	2,209
役員退職慰労引当金	101	93
繰延税金負債	1,745	1,410
その他	2	-
固定負債計	3,920	3,714
負債合計	21,722	19,435
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		

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

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	90,924	88,850
その他営業収益	933	799
営業収益計	91,858	89,650
営業費用		
支払手数料	49,978	46,165
広告宣伝費	670	646
調査費	9,013	10,116
調査費	867	925
委託調査費	8,146	9,191
委託計算費	756	761
営業雑経費	1,289	1,346
通信費	252	249
印刷費	481	515
協会費	53	53
諸会費	13	14
その他営業雑経費	488	513
営業費用計	61,709	59,036
一般管理費		
給料	5,881	5,797
役員報酬	289	354
給料・手当	3,803	3,850
賞与	695	654
賞与引当金繰入額	1,092	937
福利厚生費	831	837

交際費	45	70
旅費交通費	176	211
租税公課	259	325
不動産賃借料	1,180	1,258
退職給付費用	383	394
役員退職慰労引当金繰入額	38	37
固定資産減価償却費	1,032	1,110
諸経費	1,372	1,486
一般管理費計	11,201	11,531
営業利益	18,948	19,082

（単位:百万円）

	前事業年度 （自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）		当事業年度 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金	1	1,226	1	109
受取利息		20		25
投資有価証券売却益		145		115
外国税関連費用引当金戻入益		-		171
その他		226		73
営業外収益計		1,620		496
営業外費用				
投資有価証券売却損		84		14
その他		67		94
営業外費用計		152		108
経常利益		20,416		19,471
特別利益				
固定資産売却益		7		-
特別利益計		7		-
特別損失				
外国税関連費用		746		-
その他		26		-
特別損失計		772		-
税引前当期純利益		19,651		19,471
法人税、住民税及び事業税		6,238		6,215
法人税等調整額		17		6
法人税等合計		6,220		6,209
当期純利益		13,431		13,262

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	15,174	11,495	374	14,126	14,501	41,171
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	△13,428	△13,428	△13,428
当期純利益	-	-	-	13,262	13,262	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	△166	△166	△166
当期末残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	702	702	41,873
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	△13,428
当期純利益	-	-	13,262
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△422	△422	△422
当期変動額合計	△422	△422	△589
当期末残高	280	280	41,284

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。



なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

## (2) 無形固定資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

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

### (2) 退職給付引当金

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

## (表示方法の変更)

### (損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」の「その他」に含めておりました「投資有価証券売却益」は、営業外収益の総額の100分の10を超えたため、当事業年度より独立掲記することとしております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた372百万円は、「投資有価証券売却益」145百万円、「その他」226百万円として組替えております。

## (貸借対照表関係)

### 1 有形固定資産の減価償却累計額

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

## 2 関係会社項目

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

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

## 3 保証債務

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,749百万円に対して保証を行っております。

## (損益計算書関係)

## 1 関係会社項目

関係会社に対する営業外収益には次のものがあります。

	前事業年度 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
受取配当金	1,065百万円	-

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

## 1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位：千株)

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

## 2 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日

平成26年6月25日 定時株主総会	普通株式	10,126	3,882	平成26年 3月31日	平成26年 6月26日
----------------------	------	--------	-------	----------------	----------------

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

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

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

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

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

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

平成28年6月23日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## ( ) 為替変動リスクの管理

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

## ( ) 価格変動リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 現金・預金	31,715	31,715	-
(2) 未収委託者報酬	9,896	9,896	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,987	7,987	-
資産計	49,599	49,599	-
(1) 未払手数料	4,330	4,330	-
(2) その他未払金	4,390	4,390	-
(3) 未払費用(*)	3,420	3,420	-
負債計	12,141	12,141	-

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：百万円）

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成27年3月31日）

（単位：百万円）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,715	-	-	-
未収委託者報酬	9,896	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	1,115	4,570	1,712	141
合計	42,727	4,570	1,712	141

（有価証券関係）

## 1．子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成27年3月31日）

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

当事業年度（平成28年3月31日）

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

## 2．その他有価証券

前事業年度（平成27年3月31日）

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

その他 証券投資信託	5,779	5,793	14
小計	5,779	5,793	14
合計	10,520	9,482	1,038

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

当事業年度(平成28年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	141	55	86
(2) その他 証券投資信託	3,875	3,408	466
小計	4,016	3,463	553
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,970	4,119	148
小計	3,970	4,119	148
合計	7,987	7,583	404

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

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

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

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	3	-	0
(2) その他 証券投資信託	19,069	115	13
合計	19,072	115	14

### 4. 減損処理を行った有価証券

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

当事業年度において、証券投資信託について4百万円の減損処理を行っております。

## (退職給付関係)

### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

### 2. 確定給付制度

#### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

#### (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

### 3. 確定拠出制度



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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

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

### 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.34%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。

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

（セグメント情報等）

#### [セグメント情報]

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

#### [関連情報]

##### 1. サービスごとの情報

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

##### 2. 地域ごとの情報

###### （1）営業収益

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

###### （2）有形固定資産

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

##### 3. 主要な顧客ごとの情報

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

#### [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

#### [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## （関連当事者情報）

## 1．関連当事者との取引

## （ア）財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,834	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,749	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## （イ）財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料 (注2)	28,838	未払手数料	3,751
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	685	未払費用	348
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	978	長期差入保証金	971

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	27,062	未払手数料	3,188
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	593	未払費用	252
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,028	長期差入保証金	1,027

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)		当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,052.69円	1株当たり純資産額	15,826.85円
1株当たり当期純利益	5,148.94円	1株当たり当期純利益	5,084.10円

(注1)潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
当期純利益(百万円)	13,431	13,262
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

<訂正後>

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

##### a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

平成27年6月26日付で、定款について次の変更をいたしました。

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

##### b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

## 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28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28年3月 末日現在)	事業の内容
株式会社SBI証券	47,937	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
寿証券株式会社	305	
高木証券株式会社	11,069	
奈良証券株式会社	117	
ニュース証券株式会社	1,000	
日の出証券株式会社	4,650	
松阪証券株式会社	100	
むさし証券株式会社	5,000	
楽天証券株式会社	7,495	
岐阜信用金庫	21,519	
株式会社きらやか銀行	22,700	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社佐賀共栄銀行	2,679	
株式会社静岡中央銀行	2,000	
株式会社商工組合中央金庫	218,653	(注2)
湘南信用金庫	25,126	(注1)
全国信用協同組合連合会	59,155	(注3)
株式会社但馬銀行	5,481	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社東北銀行	13,233	
株式会社東和銀行	38,653	
株式会社栃木銀行	27,408	
株式会社富山第一銀行	10,182	
株式会社福岡中央銀行	2,500	

株式会社福島銀行	18,127
ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング・コーポレーション・リミテッド(香港上海銀行)	1,922,990

(注1) 信用金庫法に基づく金融業を営んでいます。

(注2) 主として中小企業向け融資業を営んでいます。

(注3) 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。

<参考> 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」および「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の投資顧問会社

名称 コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

資本金の額 497千米ドル(約59百万円)(平成27年12月末日現在)

事業の内容 資産運用業務を行なっています。

<参考> 「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の投資顧問会社

名称 パイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッド

資本金の額 1,032,912ユーロ(約134百万円)(平成27年12月末日現在)

事業の内容 資産運用業務を行なっています。

## 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ないます。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ないます。

## 3 【資本関係】

委託会社は、寿証券株式会社の株式を185,000株所有しております。

委託会社は、奈良証券株式会社の株式を250,000株所有しております。

委託会社は、むさし証券株式会社の株式を207,750株所有しております。

<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28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28年6月10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」に掲げられている安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成27年11月11日から平成28年5月10日までの特定期間の財務諸表、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、安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成28年5月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月10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」に掲げられているインカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成27年11月11日から平成28年5月10日までの特定期間の財務諸表、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、インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成28年5月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成28年6月10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」に掲げられている成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成27年11月11日から平成28年5月10日までの特定期間の財務諸表、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、成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）の平成28年5月10日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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28年 5月27日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

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

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

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

---

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