

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 平成29年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29年2月4日から平成30年2月2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29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】

##### (1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

<略>

<ファンドの特色>

<略>

5 <略>

<略>

#### 〈バイオニア・インベストメント・マネジメント・リミテッドについて〉

- ・欧州を基盤とした運用グループである「バイオニア・インベストメンツ・グループ」の運用拠点の一つ。特に欧州株式、欧州債券の運用に強みを持つ。
- ・運用哲学：リサーチ・チームによるファンダメンタルズ分析、クウォンツ・チームによる定量分析・リスク管理、ポートフォリオ・マネージャーによるアクティブな運用を総合的に生かすことにより、さまざまな投資機会を捉え、グローバルな観点から投資を行ない超過収益の獲得をめざす。
- ・所在地：アイルランド ダブリン

<略>

##### (3) 【ファンドの仕組み】

<更新後>

<略>

<委託会社の概況（平成29年5月末日現在）>

<略>

#### 2 【投資方針】

##### (3) 【運用体制】

<更新後>

<略>

上記の運用体制は平成29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】

&lt;更新後&gt;

&lt;略&gt;

## 参 考 情 報

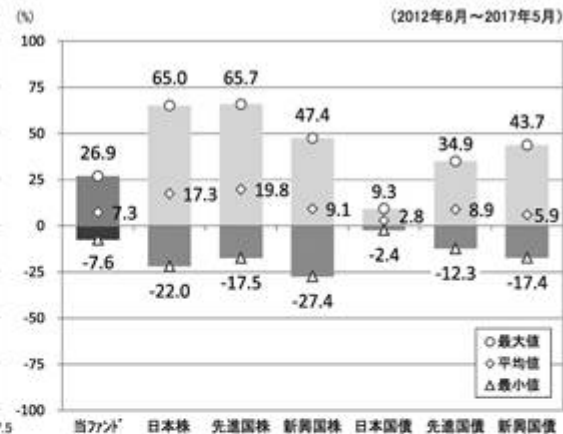
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率(各月末における直近1年間の騰落率)の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

## ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

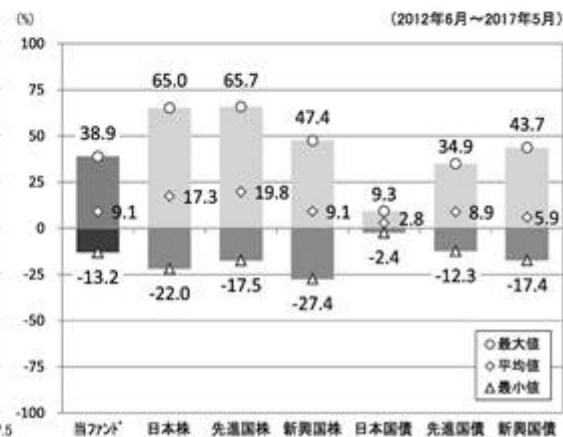
## [安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)]



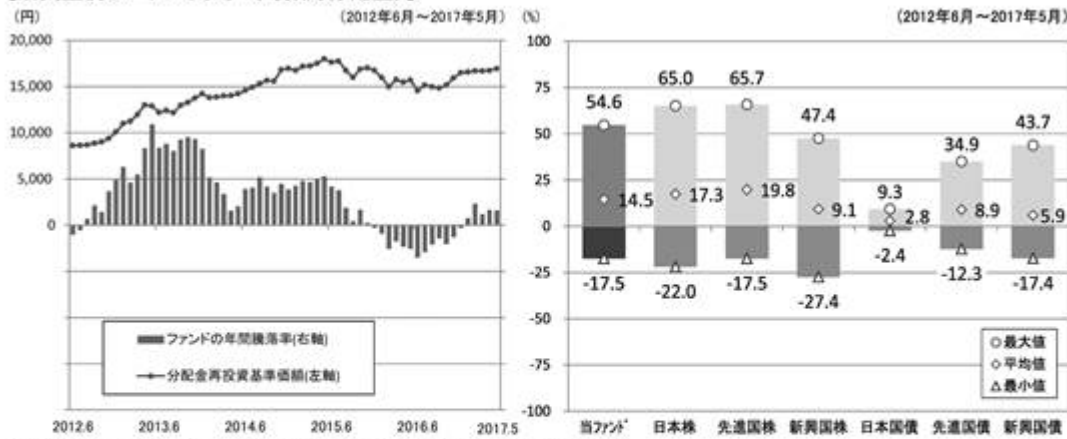
## 他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



## [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— エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

## ※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村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、知的財産権その他一切の権利は同社に帰属します。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックス— 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】

< 更新後 >

< 略 >

( ) 上記は、平成29年5月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

< 略 >

## 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29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	1,087,066,404	99.04
内 日本	1,087,066,404	99.04
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,557,220	0.96
純資産総額	1,097,623,624	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29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	235,415,102	1.6248 382,502,465	1.6297 383,655,991	34.95
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	305,971,083	1.2521 383,136,216	1.2524 383,198,184	34.91
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	42,009,770	2.6167 109,926,966	2.5522 107,217,334	9.77
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	25,897,704	2.1103 54,654,514	2.0886 54,089,944	4.93
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	22,851,019	2.3938 54,700,769	2.3622 53,978,677	4.92
6	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	21,765,385	1.6331 35,545,052	1.6235 35,336,102	3.22
7	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	15,165,602	2.3636 35,845,417	2.3145 35,100,785	3.20
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	16,732,674	2.0977 35,100,135	2.0612 34,489,387	3.14

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.04%

合計	99.04%
----	--------

(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
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
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
平成28年5月末日	1,263,587,348	-	0.9109	-
6月末日	1,205,924,258	-	0.8769	-
7月末日	1,207,872,212	-	0.8882	-
8月末日	1,195,922,159	-	0.8797	-
9月末日	1,177,628,975	-	0.8685	-
10月末日	1,165,425,198	-	0.8700	-
第22特定期間末 (平成28年11月10日)	1,158,313,348	1,162,998,429	0.8653	0.8688
11月末日	1,180,777,246	-	0.8881	-
12月末日	1,173,311,046	-	0.9055	-
平成29年1月末日	1,141,324,968	-	0.8976	-
2月末日	1,137,028,895	-	0.8997	-
3月末日	1,121,244,589	-	0.8956	-
4月末日	1,113,148,505	-	0.8982	-
第23特定期間末 (平成29年5月10日)	1,123,093,842	1,126,188,676	0.9072	0.9097
5月末日	1,097,623,624	-	0.9030	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第22特定期間	0.0105



第23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
第22特定期間	2.9
第23特定期間	5.7

#### (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第22特定期間	25,510,906	101,880,470
第23特定期間	16,442,452	117,103,386

(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29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		30,099,168,679	91.76
	内 ユーロ	7,796,000,723	23.77
	内 ノルウェー	422,052,012	1.29
	内 スウェーデン	687,093,641	2.09
	内 デンマーク	960,554,791	2.93
	内 イギリス	3,531,324,956	10.77
	内 ポーランド	2,265,620,148	6.91
	内 カナダ	2,212,442,482	6.74
	内 アメリカ	8,224,062,492	25.07
	内 オーストラリア	4,000,017,434	12.19
特殊債券		1,824,593,943	5.56
	内 カナダ	1,824,593,943	5.56
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		878,577,002	2.68
純資産総額		32,802,339,624	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)		2,669,444,767	8.14
	内 日本	2,669,444,767	8.14
為替予約取引(売建)		2,663,026,000	8.12
	内 日本	2,663,026,000	8.12

(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29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	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	35,000,000	94.38 3,665,512,628	95.60 3,713,071,124	1.625000 2026/02/15	11.32
2	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	24,000,000	119.53 2,378,188,776	121.95 2,426,456,472	4.500000 2033/04/21	7.40
3	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	18,000,000	103.17 2,301,937,425	103.90 2,318,224,455	0.800000 2025/06/22	7.07

4	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	12,800,000	136.64 2,167,970,777	137.27 2,177,981,971	5.400000 2025/03/13	6.64
5	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	9,300,000	132.36 1,751,023,530	132.45 1,752,214,162	5.000000 2025/03/07	5.34
6	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	16,500,000	114.90 1,571,687,007	115.03 1,573,560,961	5.750000 2021/05/15	4.80
7	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	44,000,000	112.80 1,473,574,080	113.22 1,479,060,792	5.750000 2021/10/25	4.51
8	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	14,000,000	105.88 1,223,256,675	107.85 1,245,981,032	2.250000 2025/06/01	3.80
9	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	8,700,000	113.13 1,220,019,026	114.72 1,237,154,246	2.250000 2024/05/25	3.77
10	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	10,100,000	98.37 1,102,484,690	99.03 1,109,926,111	1.375000 2021/04/30	3.38
11	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	8,000,000	100.94 1,000,990,452	102.07 1,012,126,120	1.000000 2026/05/15	3.09
12	Mexico Government International Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	108.45 962,688,960	108.85 966,239,680	5.125000 2020/01/15	2.95
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	99.32 881,714,790	100.66 893,574,195	2.250000 2025/11/15	2.72
14	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	43,000,000	113.13 810,483,676	112.54 806,249,871	1.750000 2025/11/15	2.46
15	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	27,000,000	97.63 782,671,450	98.12 786,559,356	2.250000 2022/04/25	2.40
16	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	4,200,000	129.61 674,757,522	133.98 697,522,923	3.250000 2045/05/25	2.13
17	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	4,500,000	104.32 667,778,400	105.00 672,131,250	1.500000 2026/07/22	2.05
18	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	8,000,000	99.30 655,571,888	101.63 670,940,412	1.500000 2026/06/01	2.05
19	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	6,000,000	90.04 599,490,249	92.18 613,744,171	2.500000 2046/02/15	1.87
20	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	7,000,000	101.98 589,123,483	103.97 600,618,519	2.250000 2025/12/15	1.83
21	US Treasury Inflation Indexed Bonds	アメリカ	国債証券	4,700,000	101.75 530,674,626	102.41 534,114,064	0.250000 2025/01/15	1.63
22	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	36,500,000	108.93 504,575,211	109.13 505,478,422	1.500000 2023/11/13	1.54
23	Japan Bank For International Cooperation	カナダ	特殊債券	5,000,000	100.88 416,230,880	100.79 415,896,674	2.300000 2018/03/19	1.27
24	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	5,000,000	99.54 410,718,544	100.06 412,876,442	1.250000 2021/06/15	1.26
25	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	4,500,000	104.69 388,766,986	106.42 395,202,308	2.550000 2025/03/15	1.20
26	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,500,000	100.52 390,391,122	101.29 393,393,145	2.000000 2021/11/15	1.20
27	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	2,200,000	104.57 327,251,815	104.69 327,627,355	1.500000 2021/01/22	1.00
28	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	2,000,000	105.85 301,143,250	105.83 301,086,350	2.000000 2020/07/22	0.92

29	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	111.50 293,250,260	111.60 293,531,670	3.000000 2024/03/14	0.89
30	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,500,000	146.84 273,021,566	148.49 276,087,469	3.750000 2045/06/22	0.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	91.76%
特殊債券	5.56%
合計	97.32%

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

#### 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	カナダ・ドル買/円売 2017年6月	買建	32,360,829	2,671,040,000	2,669,444,767	8.14%
		ノルウェー・クローネ売/ 円買 2017年6月	売建	900,000	11,834,820	11,826,000	0.04%
		豪ドル売/円買 2017年6月	売建	32,000,000	2,671,040,000	2,651,200,000	8.08%

(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。

#### ダイワ日本国債マザーファンド

#### (1) 投資状況 (平成29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	356,282,410,090	99.26
内 日本	356,282,410,090	99.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,666,694,601	0.74
純資産総額	358,949,104,691	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29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	1 30年国債	日本	国債証券	13,550,000,000	131.70 17,846,257,500	132.24 17,919,468,500	2.800000 2029/09/20	4.99
2	4 30年国債	日本	国債証券	11,300,000,000	134.80 15,232,820,000	135.49 15,311,387,000	2.900000 2030/11/20	4.27
3	43 20年国債	日本	国債証券	14,172,000,000	107.88 15,288,753,600	107.04 15,170,133,960	2.900000 2019/09/20	4.23
4	101 20年国債	日本	国債証券	11,160,000,000	124.58 13,903,797,600	124.83 13,931,586,000	2.400000 2028/03/20	3.88
5	6 30年国債	日本	国債証券	10,150,000,000	129.83 13,177,939,000	130.20 13,215,604,500	2.400000 2031/11/20	3.68
6	106 20年国債	日本	国債証券	10,480,000,000	123.35 12,927,796,800	123.46 12,939,341,600	2.200000 2028/09/20	3.60
7	64 20年国債	日本	国債証券	11,235,000,000	112.79 12,672,251,550	112.61 12,651,845,850	1.900000 2023/09/20	3.52
8	48 20年国債	日本	国債証券	11,501,000,000	110.04 12,655,817,120	109.38 12,580,713,880	2.500000 2020/12/21	3.50
9	70 20年国債	日本	国債証券	10,438,000,000	117.65 12,280,493,700	117.49 12,264,441,240	2.400000 2024/06/20	3.42
10	40 20年国債	日本	国債証券	11,742,000,000	103.94 12,205,456,740	103.20 12,118,683,360	2.300000 2018/09/20	3.38
11	54 20年国債	日本	国債証券	10,587,000,000	111.07 11,759,616,120	110.56 11,705,410,680	2.200000 2021/12/20	3.26
12	68 20年国債	日本	国債証券	9,475,000,000	115.80 10,972,144,750	115.54 10,947,699,250	2.200000 2024/03/20	3.05
13	37利付国債20年	日本	国債証券	10,723,000,000	101.77 10,913,333,250	100.97 10,827,978,170	3.100000 2017/09/20	3.02
14	42 20年国債	日本	国債証券	10,248,000,000	105.76 10,838,894,000	104.98 10,758,760,320	2.600000 2019/03/20	3.00
15	102 20年国債	日本	国債証券	8,570,000,000	125.35 10,742,505,700	125.27 10,735,810,400	2.400000 2028/06/20	2.99
16	7 30年国債	日本	国債証券	8,000,000,000	129.20 10,336,200,000	129.19 10,335,760,000	2.300000 2032/05/20	2.88
17	88 20年国債	日本	国債証券	8,460,000,000	120.75 10,216,042,200	120.64 10,206,905,400	2.300000 2026/06/20	2.84
18	95 20年国債	日本	国債証券	8,105,000,000	122.36 9,917,359,050	122.55 9,933,406,950	2.300000 2027/06/20	2.77
19	38利付国債20年	日本	国債証券	9,526,000,000	103.08 9,819,781,840	102.29 9,744,240,660	2.700000 2018/03/20	2.71
20	82 20年国債	日本	国債証券	7,965,000,000	117.54 9,362,215,100	117.53 9,361,264,500	2.100000 2025/09/20	2.61
21	86 20年国債	日本	国債証券	7,400,000,000	120.35 8,905,974,000	120.18 8,893,320,000	2.300000 2026/03/20	2.48
22	56 20年国債	日本	国債証券	8,020,000,000	111.20 8,918,526,200	110.68 8,876,937,000	2.000000 2022/06/20	2.47
23	91 20年国債	日本	国債証券	7,200,000,000	121.28 8,732,248,000	121.11 8,719,992,000	2.300000 2026/09/20	2.43

24	44	20年国債	日本	国債証券	8,035,000,000	108.09 8,685,377,000	107.41 8,630,634,550	2.500000 2020/03/20	2.40
25	5	30年国債	日本	国債証券	6,800,000,000	125.93 8,563,240,000	126.82 8,624,100,000	2.200000 2031/05/20	2.40
26	75	20年国債	日本	国債証券	6,774,000,000	116.69 7,904,848,600	116.64 7,901,667,780	2.100000 2025/03/20	2.20
27	58	20年国債	日本	国債証券	6,825,000,000	111.07 7,580,595,750	110.71 7,556,503,500	1.900000 2022/09/20	2.11
28	59	20年国債	日本	国債証券	5,595,000,000	110.38 6,175,816,950	110.07 6,158,808,150	1.700000 2022/12/20	1.72
29	47	20年国債	日本	国債証券	5,550,000,000	108.39 6,016,041,000	107.73 5,979,070,500	2.200000 2020/09/21	1.67
30	80	20年国債	日本	国債証券	4,723,000,000	117.17 5,533,939,100	117.09 5,530,255,160	2.100000 2025/06/20	1.54

(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	99.26%
合計	99.26%

(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29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	111,708,995,635	96.93
内 香港	2,482,271,659	2.15
内 シンガポール	6,254,045,476	5.43
内 イギリス	12,821,546,618	11.13
内 オランダ	750,861,288	0.65
内 ベルギー	1,487,400,964	1.29
内 フランス	7,718,302,563	6.70
内 ドイツ	3,023,681,945	2.62

	内 スペイン	3,699,942,676	3.21
	内 カナダ	1,565,632,684	1.36
	内 アメリカ	54,314,152,298	47.13
	内 オーストラリア	17,591,157,464	15.26
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		3,534,781,944	3.07
純資産総額		115,243,777,579	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)		277,375,000	0.24
	内 日本	277,375,000	0.24

(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29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	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	6,928,867	642.11 4,449,685,889	707.40 4,901,544,608	4.25
2	KLEPIERRE	フランス	投資証券	956,291	4,372.95 4,181,818,466	4,594.82 4,393,991,229	3.81
3	DEXUS	オーストラリア	投資証券	5,130,848	764.33 3,921,702,099	853.04 4,376,823,709	3.80
4	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	5,832,909	624.23 3,641,512,547	699.67 4,081,146,437	3.54
5	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	228,238	18,429.56 4,206,348,007	17,196.58 3,924,913,209	3.41
6	AVALONBAY COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	171,684	20,124.81 3,455,113,906	21,228.86 3,644,656,836	3.16
7	GECINA SA	フランス	投資証券	196,051	14,594.98 2,861,362,376	16,956.36 3,324,311,334	2.88
8	UDR INC	アメリカ	投資証券	737,671	3,893.58 2,872,185,773	4,254.20 3,138,204,689	2.72
9	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	スペイン	投資証券	2,191,218	1,321.05 2,894,989,530	1,397.53 3,062,306,587	2.66
10	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	ドイツ	投資証券	1,991,377	1,354.15 2,696,630,634	1,518.38 3,023,681,945	2.62
11	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	98,123	25,072.52 2,460,198,272	28,315.88 2,778,439,329	2.41
12	LINK REIT	香港	投資証券	2,834,420	729.80 2,068,559,716	875.76 2,482,271,659	2.15
13	KEPPEL DC REIT	シンガポール	投資証券	20,477,213	93.69 1,918,583,804	103.30 2,115,361,630	1.84

14	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	215,149	8,799.12 1,893,123,590	9,561.42 2,057,130,640	1.79
15	BIG YELLOW GROUP PLC	イギリス	投資証券	1,825,747	1,009.97 1,843,958,826	1,125.90 2,055,624,522	1.78
16	VENTAS INC	アメリカ	投資証券	278,405	6,586.58 1,833,738,364	7,383.27 2,055,541,623	1.78
17	FORTUNE REIT	シンガポール	投資証券	14,679,070	121.89 1,789,296,430	137.13 2,012,958,484	1.75
18	SL GREEN REALTY CORP	アメリカ	投資証券	173,914	11,729.58 2,039,938,454	11,231.37 1,953,292,691	1.69
19	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	10,367,637	178.06 1,846,809,908	185.69 1,925,228,720	1.67
20	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	207,481	8,225.46 1,706,627,662	8,562.78 1,776,614,821	1.54
21	DUKE REALTY CORP	アメリカ	投資証券	554,136	2,944.21 1,631,501,264	3,163.46 1,752,992,390	1.52
22	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	279,745	5,476.98 1,532,159,337	6,194.89 1,732,991,405	1.50
23	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	7,640,529	220.01 1,681,676,611	223.00 1,703,845,608	1.48
24	INVESTA OFFICE FUND	オーストラリア	投資証券	4,389,327	382.33 1,678,330,199	386.31 1,695,658,471	1.47
25	VORNADO REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	162,894	11,367.85 1,851,754,884	10,224.96 1,665,585,286	1.45
26	EDUCATION REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	390,320	4,324.11 1,687,787,084	4,236.45 1,653,572,257	1.43
27	NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア	投資証券	13,294,696	117.71 1,565,025,024	121.03 1,609,110,236	1.40
28	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	カナダ	投資証券	501,527	2,961.64 1,485,343,829	3,121.73 1,565,632,684	1.36
29	SCENTRE GROUP	オーストラリア	投資証券	4,448,129	340.71 1,515,562,065	348.18 1,548,749,555	1.34
30	ASSURA PLC	イギリス	投資証券	16,195,689	83.78 1,357,643,825	89.61 1,451,417,159	1.26

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.93%
合計	96.93%

(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 2017年6月	売建	2,500,000	277,375,000	277,375,000	0.24%

(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-REITアクティブ・マザーファンド

### (1) 投資状況 (平成29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	79,899,860,000	97.46
内 日本	79,899,860,000	97.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,083,652,080	2.54
純資産総額	81,983,512,080	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29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	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	9,900	606,162.86 6,001,012,350	582,000.00 5,761,800,000	7.03
2	日本ビルファンド	日本	投資証券	9,100	616,895.92 5,613,752,933	590,000.00 5,369,000,000	6.55
3	野村不動産マスターF	日本	投資証券	27,000	163,500.00 4,414,500,000	166,600.00 4,498,200,000	5.49
4	オリックス不動産投資	日本	投資証券	20,000	178,800.00 3,576,000,000	175,400.00 3,508,000,000	4.28
5	日本リテールファンド	日本	投資証券	15,000	221,300.00 3,319,500,000	215,300.00 3,229,500,000	3.94
6	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	11,000	287,600.00 3,163,600,000	285,200.00 3,137,200,000	3.83
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	13,000	242,200.00 3,148,600,000	240,700.00 3,129,100,000	3.82
8	API投資法人	日本	投資証券	6,000	532,000.00 3,192,000,000	511,000.00 3,066,000,000	3.74
9	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	16,000	170,700.00 2,731,200,000	163,000.00 2,608,000,000	3.18
10	森ヒルズリート	日本	投資証券	18,000	145,800.00 2,624,400,000	141,300.00 2,543,400,000	3.10

11	GLP投資法人	日本	投資証券	20,000	129,600.00 2,592,000,000	124,900.00 2,498,000,000	3.05
12	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	4,000	647,000.00 2,588,000,000	617,000.00 2,468,000,000	3.01
13	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	30,000	77,400.00 2,322,000,000	80,300.00 2,409,000,000	2.94
14	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	8,000	298,000.00 2,384,000,000	293,800.00 2,350,400,000	2.87
15	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	4,000	501,000.00 2,004,000,000	484,500.00 1,938,000,000	2.36
16	イオンリート投資	日本	投資証券	15,000	124,700.00 1,870,500,000	121,800.00 1,827,000,000	2.23
17	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	4,000	430,000.00 1,720,000,000	423,500.00 1,694,000,000	2.07
18	産業ファンド	日本	投資証券	3,000	501,000.00 1,503,000,000	500,000.00 1,500,000,000	1.83
19	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	485,500.00 1,456,500,000	491,500.00 1,474,500,000	1.80
20	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	6,000	251,700.00 1,510,200,000	245,100.00 1,470,600,000	1.79
21	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	5,800	250,100.00 1,450,580,000	242,600.00 1,407,080,000	1.72
22	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	10,000	143,300.00 1,433,000,000	140,100.00 1,401,000,000	1.71
23	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	7,000	184,800.00 1,293,600,000	183,200.00 1,282,400,000	1.56
24	森トラスト総合リート	日本	投資証券	7,000	181,966.47 1,273,765,306	179,600.00 1,257,200,000	1.53
25	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,200	573,000.00 1,260,600,000	564,000.00 1,240,800,000	1.51
26	福岡リート投資法人	日本	投資証券	7,000	178,400.00 1,248,800,000	175,600.00 1,229,200,000	1.50
27	積水ハウス・SI レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	10,000	119,300.00 1,193,000,000	120,600.00 1,206,000,000	1.47
28	グローバル・ワン不動産投資法人	日本	投資証券	3,000	392,500.00 1,177,500,000	400,000.00 1,200,000,000	1.46
29	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	4,900	237,800.00 1,165,220,000	238,200.00 1,167,180,000	1.42
30	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	14,000	81,800.00 1,145,200,000	82,700.00 1,157,800,000	1.41

(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	97.46%
合計	97.46%

(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29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		1,456,180,327	71.73
	内 カナダ	48,615,758	2.39
	内 アメリカ	1,407,564,569	69.34
ハイブリッド優先証券		443,511,943	21.85
	内 アメリカ	443,511,943	21.85
投資証券		43,220,043	2.13
	内 アメリカ	43,220,043	2.13
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		87,032,486	4.29
純資産総額		2,029,944,799	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29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	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	550	93,226.37 51,274,505	110,535.02 60,794,263	2.99
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	3,500	15,650.90 54,778,178	17,051.22 59,679,281	2.94
3	AETNA INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	3,000	14,470.29 43,410,972	16,150.22 48,450,684	2.39
4	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	5,941	7,218.05 42,882,877	7,812.69 46,415,213	2.29
5	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	17,402	2,485.17 43,248,839	2,542.09 44,237,513	2.18
6	ALTRIA GROUP INC	アメリカ	株式	生活必需品	4,800	7,905.67 37,947,600	8,329.76 39,982,883	1.97
7	ACCENTURE PLC-CL A	アメリカ	株式	情報技術	2,700	12,744.86 34,411,137	13,733.51 37,080,502	1.83

8	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	3,792	9,401.86 35,652,147	9,309.54 35,301,791	1.74
9	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必需品	3,341	9,989.72 33,375,684	9,697.90 32,400,697	1.60
10	CHUBB LTD	アメリカ	株式	金融	2,000	15,267.31 30,534,707	15,744.11 31,488,229	1.55
11	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	8,200	3,759.32 30,826,463	3,565.14 29,234,187	1.44
12	NEXTERA ENERGY INC	アメリカ	株式	公益事業	1,825	14,510.23 26,481,187	15,606.52 28,481,906	1.40
13	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	アメリカ	株式	資本財・サービス	2,388	11,510.99 27,488,245	11,851.63 28,301,711	1.39
14	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技術	6,612	4,014.42 26,543,650	4,014.53 26,544,091	1.31
15	EXPEDIA INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	1,637	14,217.30 23,273,728	15,994.88 26,183,625	1.29
16	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	2,853	9,064.32 25,860,512	8,998.85 25,673,736	1.26
17	CVS HEALTH CORP	アメリカ	株式	生活必需品	2,939	8,652.54 25,430,126	8,518.39 25,035,575	1.23
18	WELLS FARGO & CO	アメリカ	株式	金融	4,320	5,697.79 24,614,479	5,787.67 25,002,750	1.23
19	ANTHEM INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,185	18,307.29 21,694,139	20,341.18 24,104,307	1.19
20	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	2,000	12,560.67 25,121,344	12,021.40 24,042,813	1.18
21	FIRST AMERICAN FINANCIAL	アメリカ	株式	金融	5,026	4,263.52 21,429,038	4,766.84 23,958,146	1.18
22	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	5,600	4,469.46 25,029,025	4,277.50 23,954,045	1.18
23	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,696	13,868.89 23,521,638	14,104.12 23,920,597	1.18
24	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	6,791	3,597.32 24,429,422	3,515.21 23,871,810	1.18
25	GENERAL DYNAMICS CORP	アメリカ	株式	資本財・サービス	1,044	20,719.56 21,631,221	22,415.02 23,401,291	1.15
26	NORTHROP GRUMMAN CORP	アメリカ	株式	資本財・サービス	810	26,652.59 21,588,600	28,429.06 23,027,540	1.13
27	TE CONNECTIVITY LTD	アメリカ	株式	情報技術	2,600	7,936.96 20,636,119	8,766.94 22,794,069	1.12
28	ABBOTT LABORATORIES	アメリカ	株式	ヘルスケア	4,555	4,734.66 21,566,391	4,993.20 22,744,026	1.12
29	ANALOG DEVICES INC	アメリカ	株式	情報技術	2,400	8,523.83 20,457,373	9,409.40 22,582,579	1.11
30	STARBUCKS CORP	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	3,200	6,381.30 20,420,191	7,019.32 22,461,855	1.11

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □ . 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	71.73%
ハイブリッド優先証券	21.85%
投資証券	2.13%
合計	95.71%

(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

業種	投資比率
エネルギー	5.17%
素材	1.80%
資本財・サービス	7.25%
一般消費財・サービス	6.70%
生活必需品	5.35%
ヘルスケア	11.48%
金融	14.07%
情報技術	15.68%
電気通信サービス	2.06%
公益事業	2.16%
合計	71.73%

(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。

#### ダイワ欧州好配当株マザーファンド

#### (1) 投資状況（平成29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	1,247,556,564	96.21
内 ノルウェー	27,305,415	2.11
内 スウェーデン	55,516,033	4.28
内 イギリス	338,968,937	26.14
内 オランダ	114,641,303	8.84
内 フランス	172,088,367	13.27
内 ドイツ	210,199,850	16.21
内 スイス	189,768,883	14.64
内 スペイン	32,911,049	2.54
内 イタリア	72,688,950	5.61
内 フィンランド	33,467,777	2.58
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	49,086,013	3.79

純資産総額	1,296,642,577	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29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	5,858	8,684.38 50,873,145	9,360.72 54,835,124	4.23
2	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	電気通信サービス	21,145	1,990.01 42,078,914	2,203.83 46,600,006	3.59
3	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	43,404	915.94 39,755,797	960.47 41,688,326	3.22
4	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	3,682	10,576.65 38,943,238	10,853.06 39,960,974	3.08
5	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	4,676	8,222.84 38,450,014	8,531.47 39,893,193	3.08
6	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	イギリス	株式	生活必需品	5,047	7,657.31 38,646,481	7,825.17 39,493,646	3.05
7	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,389	8,400.21 36,868,535	8,934.46 39,213,354	3.02
8	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,489	15,685.87 39,042,137	15,667.28 38,995,860	3.01
9	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	15,900	2,342.85 37,251,434	2,379.84 37,839,496	2.92
10	TOTAL SA	フランス	株式	エネルギー	6,299	5,953.31 37,499,953	5,894.44 37,129,091	2.86
11	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	14,844	2,366.32 35,125,784	2,475.15 36,741,127	2.83
12	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	イギリス	株式	エネルギー	11,761	2,996.49 35,241,792	3,008.58 35,383,998	2.73
13	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,619	21,164.46 34,265,265	21,176.85 34,285,332	2.64
14	BASF SE	ドイツ	株式	素材	3,218	11,250.94 36,205,530	10,432.87 33,572,980	2.59
15	NOKIA OYJ	フィンランド	株式	情報技術	47,705	613.30 29,257,696	701.55 33,467,777	2.58
16	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	1,034	30,315.78 31,346,526	32,168.61 33,262,343	2.57
17	ENAGAS SA	スペイン	株式	エネルギー	10,115	3,072.72 31,080,568	3,253.68 32,911,049	2.54
18	KONINKLIJKE PHILIPS NV	オランダ	株式	資本財・サービス	8,394	3,684.41 30,926,969	3,881.49 32,581,263	2.51
19	NATIONAL GRID PLC	イギリス	株式	公益事業	20,312	1,607.70 32,655,940	1,549.10 31,465,370	2.43
20	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	3,990	7,226.28 28,832,877	7,883.22 31,454,048	2.43

21	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消費財・サービス	2,996	10,266.77 30,759,268	10,441.54 31,282,878	2.41
22	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	138	215,631.99 29,757,215	226,544.31 31,263,115	2.41
23	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	1,029	29,179.08 30,025,283	30,315.78 31,194,947	2.41
24	KONINKLIJKE DSM NV	オランダ	株式	素材	3,798	8,107.56 30,792,549	8,179.46 31,065,591	2.40
25	AVIVA PLC	イギリス	株式	金融	40,669	736.14 29,938,229	746.10 30,343,191	2.34
26	SWEDBANK AB - A SHARES	スウェーデン	株式	金融	11,086	2,607.79 28,910,015	2,667.43 29,571,218	2.28
27	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事業	48,153	540.79 26,045,411	586.03 28,219,372	2.18
28	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	オランダ	株式	生活必需品	11,176	2,403.39 26,860,292	2,451.11 27,393,619	2.11
29	DNB ASA	ノルウェー	株式	金融	14,281	1,797.60 25,671,597	1,912.01 27,305,415	2.11
30	ENI SPA	イタリア	株式	エネルギー	14,849	1,858.01 27,590,685	1,774.96 26,356,440	2.03

(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	96.21%
合計	96.21%

(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	10.16%
素材	7.40%
資本財・サービス	8.60%
一般消費財・サービス	7.35%
生活必需品	11.21%
ヘルスケア	11.43%
金融	25.77%
情報技術	2.58%
電気通信サービス	7.11%
公益事業	4.60%
合計	96.21%

(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29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		864,269,502	91.46
	内 韓国	153,516,825	16.25
	内 中国	216,230,131	22.88
	内 台湾	155,049,426	16.41
	内 香港	30,363,240	3.21
	内 シンガポール	79,878,198	8.45
	内 イギリス	1,987,113	0.21
	内 オーストラリア	227,244,569	24.05
投資証券		32,213,282	3.41
	内 オーストラリア	32,213,282	3.41
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		48,502,308	5.13
純資産総額		944,985,092	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29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	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	韓国	株式	情報技術	280	207,999.00 58,239,720	220,968.00 61,871,040	6.55
2	NETEASE INC-ADR	中国	株式	情報技術	1,100	31,994.09 35,193,543	32,007.52 35,208,274	3.73
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	42,000	693.63 29,132,460	759.69 31,906,980	3.38
4	YESTAR HEALTHCARE HOLDINGS	中国	株式	ヘルスケア	579,000	56.67 32,814,941	54.53 31,578,197	3.34
5	QANTAS AIRWAYS LTD	オーストラリア	株式	資本財・サービス	75,000	402.81 30,216,550	412.84 30,963,150	3.28
6	CHALLENGER LTD	オーストラリア	株式	金融	25,500	1,077.78 27,484,967	1,079.35 27,523,629	2.91
7	HANA FINANCIAL GROUP	韓国	株式	金融	6,600	3,685.17 24,322,170	4,133.25 27,279,450	2.89
8	MM2 ASIA LTD	シンガポール	株式	一般消費財・サービス	560,000	40.44 22,646,624	46.84 26,234,208	2.78
9	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	情報技術	6,000	3,399.48 20,396,998	3,913.15 23,478,912	2.48



10	WESTPAC BANKING CORP	オーストラリア	株式	金融	9,000	2,880.77 25,926,975	2,514.35 22,629,213	2.39
11	DATANG INTL POWER GEN CO-H	中国	株式	公益事業	500,000	37.73 18,874,344	41.15 20,576,800	2.18
12	AMCOR LIMITED	オーストラリア	株式	素材	15,000	1,277.90 19,169,499	1,278.31 19,174,770	2.03
13	BHP BILLITON LIMITED	オーストラリア	株式	素材	9,600	2,015.29 19,346,870	1,989.60 19,100,160	2.02
14	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	香港	株式	情報技術	11,500	1,492.35 17,162,048	1,623.36 18,668,640	1.98
15	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	-	100,000	193.98 19,398,600	185.69 18,569,600	1.97
16	HUCHEMS FINE CHEMICAL CORP	韓国	株式	素材	7,100	2,286.90 16,236,990	2,534.40 17,994,240	1.90
17	ZTE CORP-H	中国	株式	情報技術	80,000	196.51 15,720,960	223.85 17,908,224	1.90
18	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	2,300	7,286.91 16,759,893	7,331.67 16,862,855	1.78
19	WOODSIDE PETROLEUM LTD	オーストラリア	株式	エネルギー	6,000	2,748.13 16,488,810	2,672.69 16,036,176	1.70
20	ASPEED TECHNOLOGY INC	台湾	株式	情報技術	6,000	2,309.75 13,858,544	2,664.42 15,986,520	1.69
21	HON HAI PRECISION INDUSTRY	台湾	株式	情報技術	41,000	354.88 14,550,449	383.51 15,724,115	1.66
22	CHROMA ATE INC	台湾	株式	情報技術	45,000	319.29 14,368,050	344.98 15,524,100	1.64
23	SINGAPORE TECH ENGINEERING	シンガポール	株式	資本財・サービス	51,000	300.30 15,315,300	294.69 15,029,414	1.59
24	GENTING SINGAPORE PLC	シンガポール	株式	一般消費財・サービス	160,000	87.68 14,030,016	93.29 14,926,912	1.58
25	TREASURY WINE ESTATES LTD	オーストラリア	株式	生活必需品	13,000	1,005.57 13,072,501	1,076.87 13,999,323	1.48
26	SUNNY OPTICAL TECH	中国	株式	情報技術	16,000	843.36 13,494,138	861.52 13,784,320	1.46
27	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	中国	株式	ヘルスケア	86,000	145.81 12,540,314	160.05 13,764,954	1.46
28	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	中国	株式	情報技術	1,000	12,228.90 12,228,902	13,749.05 13,749,054	1.45
29	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	-	19,500	690.55 13,465,862	699.67 13,643,682	1.44
30	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	150,000	90.70 13,606,320	90.70 13,606,320	1.44

(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	91.46%
投資証券	3.41%
合計	94.87%

(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

業種	投資比率
エネルギー	3.14%
素材	8.78%
資本財・サービス	8.89%
一般消費財・サービス	6.46%
生活必需品	2.71%
ヘルスケア	4.80%
金融	16.03%
情報技術	38.48%
公益事業	2.18%
合計	91.46%

(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29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	32,140,137,000	94.73
内 日本	32,140,137,000	94.73
投資証券	46,120,000	0.14
内 日本	46,120,000	0.14
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,742,951,746	5.14
純資産総額	33,929,208,746	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29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	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,900,000	652.69 1,240,124,333	690.90 1,312,710,000	3.87
2	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	250,000	3,816.00 954,000,000	3,974.00 993,500,000	2.93

3	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	170,000	4,760.00 809,200,000	5,308.00 902,360,000	2.66
4	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	130,000	5,759.00 748,670,000	5,932.00 771,160,000	2.27
5	伊藤忠	日本	株式	卸売業	490,000	1,499.00 734,510,000	1,573.00 770,770,000	2.27
6	三菱商事	日本	株式	卸売業	340,000	2,332.50 793,050,000	2,218.00 754,120,000	2.22
7	本田技研	日本	株式	輸送用機器	190,000	3,099.00 588,810,000	3,117.00 592,230,000	1.75
8	三菱自動車工業	日本	株式	輸送用機器	800,000	630.00 504,000,000	718.00 574,400,000	1.69
9	日産自動車	日本	株式	輸送用機器	490,000	1,010.50 495,145,000	1,061.50 520,135,000	1.53
10	MS & AD	日本	株式	保険業	132,500	3,486.00 461,895,000	3,885.00 514,762,500	1.52
11	三井物産	日本	株式	卸売業	340,000	1,531.00 520,540,000	1,495.50 508,470,000	1.50
12	大和ハウス	日本	株式	建設業	132,500	3,215.00 425,987,500	3,619.00 479,517,500	1.41
13	東京海上HD	日本	株式	保険業	100,000	4,508.00 450,800,000	4,700.00 470,000,000	1.39
14	三井金属	日本	株式	非鉄金属	1,050,000	338.33 355,254,941	441.00 463,050,000	1.36
15	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	170,000	2,597.00 441,490,000	2,717.00 461,890,000	1.36
16	JXTGホールディングス	日本	株式	石油・石炭製品	950,000	500.00 475,000,000	482.40 458,280,000	1.35
17	T&Dホールディングス	日本	株式	保険業	290,000	1,535.40 445,267,241	1,567.00 454,430,000	1.34
18	ソフトバンクグループ	日本	株式	情報・通信業	50,000	7,596.00 379,800,000	9,003.00 450,150,000	1.33
19	野村ホールディングス	日本	株式	証券・商品 先物取引業	650,000	647.40 420,810,000	663.40 431,210,000	1.27
20	住友鉱山	日本	株式	非鉄金属	315,000	1,481.00 466,515,000	1,346.00 423,990,000	1.25
21	住友商事	日本	株式	卸売業	290,000	1,422.00 412,380,000	1,412.50 409,625,000	1.21
22	あおぞら銀行	日本	株式	銀行業	1,000,000	383.00 383,000,000	407.00 407,000,000	1.20
23	信越化学	日本	株式	化学	40,000	9,235.00 369,400,000	9,932.00 397,280,000	1.17
24	オリックス	日本	株式	その他金融業	225,000	1,675.50 376,987,500	1,748.00 393,300,000	1.16
25	SOMPOホールディングス	日本	株式	保険業	90,000	3,922.00 352,980,000	4,274.00 384,660,000	1.13
26	第一生命HLDGS	日本	株式	保険業	200,000	1,812.83 362,566,790	1,844.50 368,900,000	1.09
27	住友不動産	日本	株式	不動産業	110,000	3,017.00 331,870,000	3,340.00 367,400,000	1.08

28	日本軽金属HD	日本	株式	非鉄金属	1,250,000	232.00 290,000,000	259.00 323,750,000	0.95
29	SUMCO	日本	株式	金属製品	175,000	1,790.00 313,250,000	1,831.00 320,425,000	0.94
30	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,650,000	189.00 311,850,000	192.80 318,120,000	0.94

(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	94.73%
投資証券	0.14%
合計	94.86%

(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
鉱業	0.24%
建設業	2.35%
食料品	0.61%
繊維製品	0.26%
化学	7.07%
医薬品	0.92%
石油・石炭製品	2.22%
ゴム製品	0.89%
ガラス・土石製品	5.26%
鉄鋼	1.46%
非鉄金属	6.89%
金属製品	1.44%
機械	5.38%
電気機器	4.36%
輸送用機器	9.09%
精密機器	0.34%
その他製品	1.44%
電気・ガス業	0.43%
陸運業	0.23%
海運業	0.20%
空運業	0.48%
情報・通信業	6.51%
卸売業	10.62%
銀行業	10.80%
証券、商品先物取引業	1.27%
保険業	6.46%
その他金融業	2.03%
不動産業	3.22%
サービス業	2.26%
合計	94.73%

(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。

【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29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	1,026,540,231	99.09
内 日本	1,026,540,231	99.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	9,431,358	0.91
純資産総額	1,035,971,589	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29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	445,766,520	1.6248 724,281,467	1.6297 726,465,697	70.12
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	39,499,978	2.6167 103,359,592	2.5522 100,811,843	9.73
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	24,508,322	2.1104 51,722,362	2.0886 51,188,081	4.94
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	20,672,094	2.3938 49,484,858	2.3622 48,831,620	4.71
5	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	14,365,197	2.3636 33,953,579	2.3145 33,248,248	3.21
6	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	20,367,407	1.6331 33,262,013	1.6235 33,066,485	3.19
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	15,975,285	2.0976 33,511,355	2.0612 32,928,257	3.18

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.09%
合計	99.09%

(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
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
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
平成28年5月末日	1,199,911,679	-	0.8499	-
6月末日	1,117,918,707	-	0.8002	-
7月末日	1,130,797,971	-	0.8174	-
8月末日	1,114,464,596	-	0.8096	-
9月末日	1,087,968,541	-	0.7945	-
10月末日	1,083,927,845	-	0.7956	-
第22特定期間末 (平成28年11月10日)	1,075,473,727	1,078,862,289	0.7935	0.7960
11月末日	1,112,545,251	-	0.8249	-
12月末日	1,127,058,413	-	0.8483	-
平成29年1月末日	1,087,759,049	-	0.8384	-
2月末日	1,064,987,174	-	0.8389	-
3月末日	1,035,761,428	-	0.8365	-
4月末日	1,032,130,315	-	0.8389	-
第23特定期間末 (平成29年5月10日)	1,046,739,352	1,048,578,766	0.8536	0.8551
5月末日	1,035,971,589	-	0.8505	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第22特定期間	0.0075
第23特定期間	0.0045

(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
第22特定期間	4.4
第23特定期間	8.1

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第22特定期間	10,094,094	66,554,667
第23特定期間	6,086,004	135,234,627



（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29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	5,083,317,329	99.18
内 日本	5,083,317,329	99.18
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	42,202,085	0.82
純資産総額	5,125,519,414	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29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	697,671,544	2.6167 1,825,597,131	2.5522 1,780,597,314	34.74
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	630,060,485	1.6248 1,023,722,278	1.6297 1,026,809,572	20.03
3	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	256,323,789	2.3636 605,846,911	2.3145 593,261,409	11.57
4	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	286,812,939	2.0977 601,647,520	2.0612 591,178,829	11.53
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	363,525,254	1.6331 593,673,103	1.6235 590,183,249	11.51
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	121,202,282	2.1104 255,785,302	2.0886 253,143,086	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	105,047,782	2.3938 251,463,380	2.3622 248,143,870	4.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

## ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.18%
合計	99.18%

(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
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
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

平成28年5月末日	5,653,734,729	-	0.8906	-
6月末日	5,181,554,580	-	0.8256	-
7月末日	5,364,495,212	-	0.8560	-
8月末日	5,261,363,939	-	0.8465	-
9月末日	5,118,822,622	-	0.8339	-
10月末日	5,194,799,106	-	0.8518	-
第22特定期間末 (平成28年11月10日)	5,116,194,834	5,140,460,598	0.8434	0.8474
11月末日	5,377,374,139	-	0.8910	-
12月末日	5,435,664,519	-	0.9238	-
平成29年1月末日	5,365,976,087	-	0.9231	-
2月末日	5,313,281,810	-	0.9302	-
3月末日	5,209,773,814	-	0.9257	-
4月末日	5,178,890,924	-	0.9288	-
第23特定期間末 (平成29年5月10日)	5,287,390,510	5,309,662,342	0.9496	0.9536
5月末日	5,125,519,414	-	0.9354	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第22特定期間	0.0120
第23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
第22特定期間	1.6
第23特定期間	14.0

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第22特定期間	35,863,134	358,150,519
第23特定期間	29,786,290	528,269,188

(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）

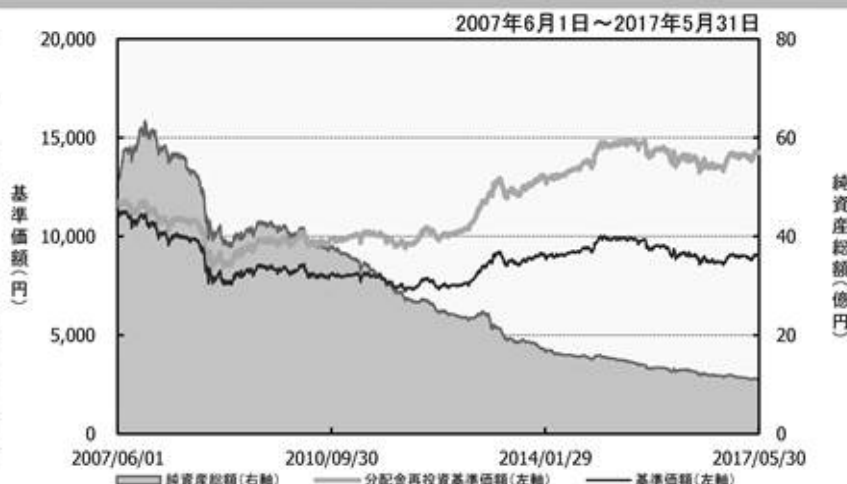
2017年5月31日現在

※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	9,030円
純資産総額	10億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	0.8%
3カ月間	0.9%
6カ月間	2.5%
1年間	1.2%
3年間	7.7%
5年間	43.8%
設定来	42.3%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額：180円 設定来分配金合計額：4,005円

決算期	第58期	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期
	15年7月	15年9月	15年11月	16年1月	16年3月	16年5月	16年7月	16年9月	16年11月	17年1月	17年3月	17年5月
分配金	50円	50円	50円	50円	50円	35円	35円	35円	35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。

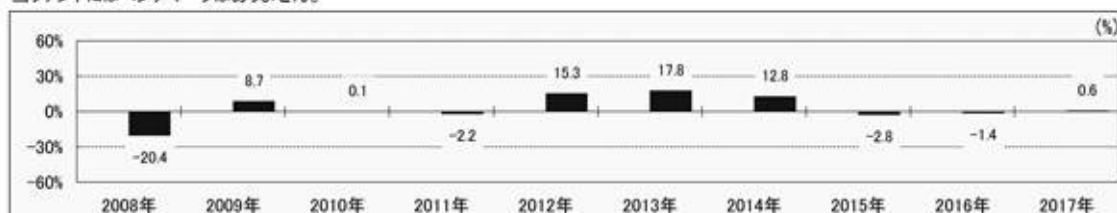
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内債券	47	34.7%	日本円	50.9%	直接利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.4%	
外国債券	39	34.0%	米ドル	14.6%	最終利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	0.3%	
国内株式	139	9.3%	ユーロ	10.9%	修正デュレーション	日本電信電話	日本	0.3%	
外国株式	158	8.3%	カナダドル	7.3%	残存年数	トヨタ自動車	日本	0.2%	
外国リート等	133	5.7%	英ポンド	5.3%	債券格付別構成	伊藤忠	日本	0.2%	
国内リート	46	4.8%	豪ドル	3.2%	AAA	90.0%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.3%
			ポーランド・ズロチ	2.5%	AA	-	日本ビルファンド	日本	0.3%
			デンマーク・クローネ	1.0%	A	10.0%	野村不動産マスターF	日本	0.3%
			スウェーデン・クローネ	0.9%	BBB	-	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.2%
コール・ローン、その他		3.4%	その他	3.3%	BB	-	オリックス不動産投資	日本	0.2%
合計	562	100.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	2.7%	

※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。

※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2017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）

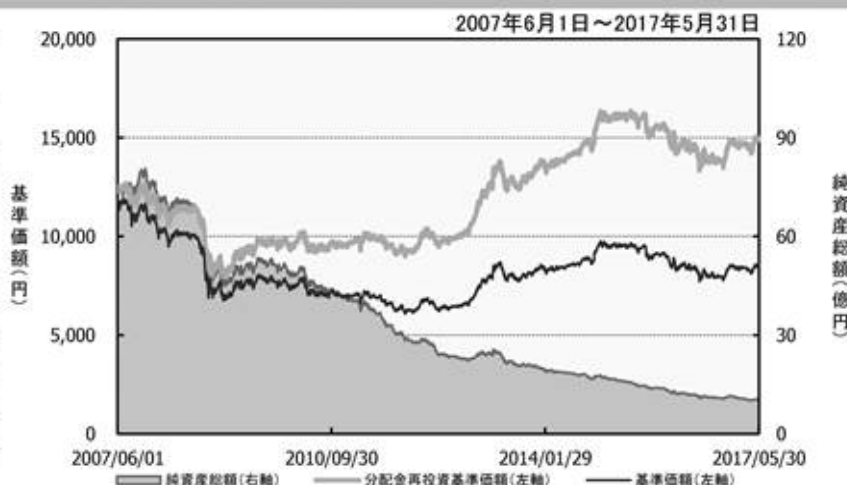
2017年5月31日現在

※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	8,505円
純資産総額	10億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.6%
3カ月間	1.7%
6カ月間	3.7%
1年間	1.6%
3年間	6.6%
5年間	55.7%
設定来	49.1%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 120円 設定来分配金合計額: 4,635円

決算期	第58期	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期
	15年7月	15年9月	15年11月	16年1月	16年3月	16年5月	16年7月	16年9月	16年11月	17年1月	17年3月	17年5月
分配金	35円	35円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	25円	15円	15円	15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。

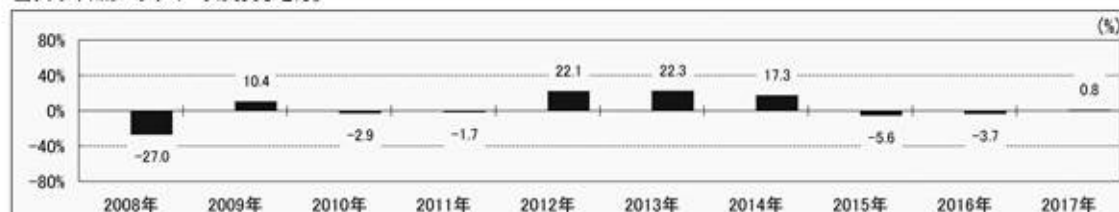
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国債券	39	68.2%	米ドル	23.6%	直接利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.4%	
国内株式	139	9.2%	ユーロ	19.4%	最終利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	0.3%	
外国株式	158	8.3%	日本円	15.7%	修正デュレーション	日本電信電話	日本	0.3%	
外国リート等	133	5.7%	カナダドル	14.6%	残存年数	トヨタ自動車	日本	0.2%	
国内リート	46	4.6%	英ポンド	9.3%	債券格付別構成 比率	伊藤忠	日本	0.2%	
			ポーランド・ズロチ	5.0%	AAA	79.9%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.3%
			豪ドル	4.8%	AA	-	日本ビルファンド	日本	0.3%
			デンマーク・クローネ	2.1%	A	20.1%	野村不動産マスターF	日本	0.3%
			スウェーデン・クローネ	1.6%	BBB	-	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.2%
コール・ローン、その他		4.0%	その他	3.8%	BB	-	SEGRO PLC	イギリス	0.2%
合計	515	100.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	2.7%	

※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。

※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2017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)



2017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	9,354円
純資産総額	51億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.1%
3カ月間	1.4%
6カ月間	6.3%
1年間	7.9%
3年間	19.1%
5年間	102.9%
設定来	69.2%



※上記の「基準価額の騰落率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

## 分配の推移（10,000口当たり、税引前）

直近1年間分配金合計額： 240円 設定来分配金合計額： 5,310円

決算期	第58期	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期
	15年7月	15年9月	15年11月	16年1月	16年3月	16年5月	16年7月	16年9月	16年11月	17年1月	17年3月	17年5月
分配金	40円	40円	40円	40円	40円	40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。

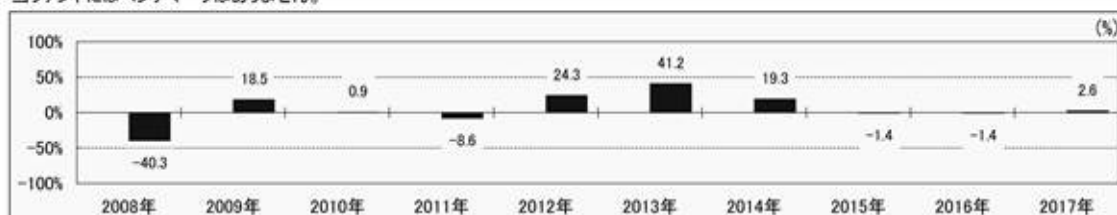
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式	139	32.9%	日本円	41.2%	直接利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	日本	1.3%	
外国株式	158	29.9%	米ドル	19.3%	最終利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	1.0%	
外国債券	39	19.5%	ユーロ	11.5%	修正デュレーション	日本電信電話	日本	0.9%	
外国リート等	133	8.0%	英ポンド	5.9%	残存年数	トヨタ自動車	日本	0.8%	
国内リート	46	4.8%	豪ドル	4.9%	債券格付別構成 比率	伊藤忠	日本	0.8%	
			カナダ・ドル	4.5%	AAA	79.9%	GOODMAN GROUP	オーストラリア	0.3%
			香港ドル	2.5%	AA	-	ジャパンリアルエステイト	日本	0.3%
			台湾ドル	2.0%	A	20.1%	日本ビルファンド	日本	0.3%
			韓国ウォン	1.9%	BBB	-	MIRVAC GROUP	オーストラリア	0.3%
コール・ローン、その他		4.9%	その他	6.4%	BB	-	野村不動産マスターF	日本	0.3%
合計	515	100.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	6.4%	

※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。

※格付別構成については、R&I、JCR、Moody's、S&P、Fitchの格付けのうち最も高いものを採用し、算出しています。

## 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



・ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

・2017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28年11月11日から平成29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【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】

（単位：円）

	前 期 平成28年11月10日現在	当 期 平成29年5月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	19,047,196	15,261,741
親投資信託受益証券	1,146,460,362	1,113,392,674
流動資産合計	1,165,507,558	1,128,654,415
資産合計	1,165,507,558	1,128,654,415
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	4,685,081	3,094,834
未払受託者報酬	102,488	100,805
未払委託者報酬	2,357,587	2,318,910
その他未払費用	49,054	46,024
流動負債合計	7,194,210	5,560,573
負債合計	7,194,210	5,560,573
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 1,338,594,634	1 1,237,933,700
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 180,281,286	2 114,839,858
（分配準備積立金）	3,974,561	4,851,509
元本等合計	1,158,313,348	1,123,093,842
純資産合計	1,158,313,348	1,123,093,842
負債純資産合計	1,165,507,558	1,128,654,415

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 平成28年5月11日 至 平成28年11月10日		自 平成28年11月11日 至 平成29年5月10日	
営業収益				
有価証券売買等損益		27,590,637		71,932,312
営業収益合計		27,590,637		71,932,312
営業費用				
支払利息		2,997		3,171
受託者報酬		327,643		307,129
委託者報酬		1 7,536,844		1 7,064,821
その他費用		49,055		46,024
営業費用合計		7,916,539		7,421,145
営業利益又は営業損失（ ）		35,507,176		64,511,167
経常利益又は経常損失（ ）		35,507,176		64,511,167
当期純利益又は当期純損失（ ）		35,507,176		64,511,167
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		142,859		1,282,144
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		139,153,563		180,281,286
剰余金増加額又は欠損金減少額		11,729,477		13,442,783
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		11,729,477		13,442,783
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,968,668		1,749,727
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,968,668		1,749,727
分配金		2 14,238,497		2 9,480,651
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		180,281,286		114,839,858

## (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28年11月11日 至 平成29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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1. 1 期首元本額	1,414,964,198円	1,338,594,634円
期中追加設定元本額	25,510,906円	16,442,452円
期中一部解約元本額	101,880,470円	117,103,386円
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,338,594,634口	1,237,933,700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180,281,286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114,839,858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28年5月11日 至 平成28年11月10日	自 平成28年11月11日 至 平成29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	333,617円	319,260円

## 2. 2 分配金の計算過程

<p>(自平成28年5月11日 至平成28年7月11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(2,677,250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(356,536円)及び分配準備積立金(10,037,711円)より分配対象額は13,071,497円(1万口当たり95.12円)であり、うち4,809,707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28年11月11日 至平成29年1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(4,214,621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(473,625円)及び分配準備積立金(3,811,548円)より分配対象額は8,499,794円(1万口当たり65.70円)であり、うち3,234,298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7月12日 至平成28年9月12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(3,370,823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(416,117円)及び分配準備積立金(7,739,967円)より分配対象額は11,526,907円(1万口当たり85.05円)であり、うち4,743,709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29年1月11日 至平成29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(1,796,331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(476,362円)及び分配準備積立金(4,656,399円)より分配対象額は6,929,092円(1万口当たり54.97円)であり、うち3,151,519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9月13日 至平成28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(2,403,424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(451,366円)及び分配準備積立金(6,256,218円)より分配対象額は9,111,008円(1万口当たり68.06円)であり、うち4,685,081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29年3月11日 至平成29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(4,711,361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(477,773円)及び分配準備積立金(3,234,982円)より分配対象額は8,424,116円(1万口当たり68.05円)であり、うち3,094,834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28年11月11日 至 平成29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	<p>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。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 平成29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28年11月10日現在	当 期 平成29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	76,254	13,842,068
合計	76,254	13,842,068

## (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28年11月10日現在	当 期 平成29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28年11月11日 至 平成29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28年11月10日現在	当 期 平成29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)	0.8653円 (8,653円)	0.9072円 (9,072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	242,788,911	394,483,422	
	ダイワ日本国債マザーファンド	306,769,487	384,136,751	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	26,371,212	55,653,805	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	42,773,404	111,925,166	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	15,592,169	36,853,650	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	23,591,043	38,526,532	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	17,692,034	37,112,579	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	22,851,019	54,700,769	
親投資信託受益証券 合計			1,113,392,674	
合計			1,113,392,674	

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」-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

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

#### 貸借対照表

	平成28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	61,128,069	275,993,847
コール・ローン	119,923,377	9,146,981
国債証券	32,522,172,536	30,442,927,298
特殊債券	1,739,032,707	1,823,878,906
派生商品評価勘定	3,600	28,479,897
未収入金	105,700,145	627,539,682
未収利息	277,037,812	277,808,872
前払費用	21,531,737	36,153,601
差入委託証拠金	442,427,446	446,049,665
流動資産合計	35,288,957,429	33,967,978,749
資産合計	35,288,957,429	33,967,978,749
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	16,696,039
未払解約金	114,930,687	464,664,518
その他未払費用	-	238
流動負債合計	114,930,687	481,360,795
負債合計	114,930,687	481,360,795
純資産の部		
元本等		

元本	1	23,024,640,668	20,609,366,208
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		12,149,386,074	12,877,251,746
元本等合計		35,174,026,742	33,486,617,954
純資産合計		35,174,026,742	33,486,617,954
負債純資産合計		35,288,957,429	33,967,978,749

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成28年11月11日 至 平成29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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <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>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</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> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</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. 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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1. 1 期首	平成28年5月11日	平成28年11月11日
期首元本額	24,905,225,364円	23,024,640,668円
期中追加設定元本額	475,992,463円	1,380,136,853円
期中一部解約元本額	2,356,577,159円	3,795,411,313円
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)	2,305,976,364円	2,188,586,660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)	749,432,704円	696,078,599円
ダイワ外債ソブリン・オープン(毎月分配型)	1,252,847,822円	1,171,412,513円
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	56,768,852円	56,242,569円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	265,377,105円	242,788,911円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	492,139,265円	449,444,050円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	663,275,114円	639,893,968円
京都応援バランスファンド(隔月分配型)	283,634,755円	264,272,083円

6 資産バランスファンド(分配型)	1,524,484,353円	1,368,380,461円
6 資産バランスファンド(成長型)	144,977,949円	139,928,362円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(毎月分配型)	11,328,456,098円	9,433,885,658円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	96,625,182円	89,081,290円
ダイワ外債ソブリン・ファンド(毎月分配型)	1,318,693,368円	446,436,011円
兵庫応援バランスファンド(毎月分配型)	547,710,565円	1,604,937,412円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	31,068,081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	357,373,192円	339,067,923円
紀陽地域株式・外債バランスファンド(隔月分配型)	67,174,031円	62,322,398円
愛媛県応援ファンド(外債バランス・毎月分配型)	74,244,701円	- 円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	1,442,994,651円	1,368,333,938円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(1年決算型)	21,386,516円	17,205,321円
計	23,024,640,668円	20,609,366,208円
2. 期末日における受益権の総数	23,024,640,668口	20,609,366,208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28年11月11日 至 平成29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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、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。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>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おります。また、信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用してしております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>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。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p> <p>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。</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29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	<p>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。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
--	---------------	--------------

種 類	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	460,964,580	135,429,319
特殊債券	18,116,831	7,447,094
合計	479,081,411	127,982,225

(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28年10月12日から平成28年11月10日まで、及び平成29年4月11日から平成29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28年11月10日 現在				平成29年5月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	31,686,600	-	31,683,000	3,600	4,714,333,179	-	4,727,224,654	12,891,475
アメリカ・ドル	31,686,600	-	31,683,000	3,600	204,291,300	-	204,930,000	638,700
イギリス・ポンド	-	-	-	-	87,973,800	-	88,488,000	514,200
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	2,712,882,500	-	2,718,805,000	5,922,500
カナダ・ドル	-	-	-	-	1,366,609,459	-	1,371,767,654	5,158,195
デンマーク・クローネ	-	-	-	-	39,887,520	-	39,984,000	96,480
ポーランド・ズロチ	-	-	-	-	116,900,000	-	117,160,000	260,000
ユーロ	-	-	-	-	185,788,600	-	186,090,000	301,400
買 建	-	-	-	-	4,004,433,459	-	4,029,108,792	24,675,333
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	1,333,393,459	-	1,339,040,000	5,646,541
カナダ・ドル	-	-	-	-	2,671,040,000	-	2,690,068,792	19,028,792

合計	31,686,600	-	31,683,000	3,600	8,718,766,638	-	8,756,333,446	11,783,858
----	------------	---	------------	-------	---------------	---	---------------	------------

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## (1口当たり情報)

	平成28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1口当たり純資産額	1.5277円	1.6248円
(1万口当たり純資産額)	(15,277円)	(16,248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	2% United States Treasury Note/Bond 20211115	4,500,000.000	4,524,570.000	
		0.25% US Treasury Inflation Indexed Bonds 20250115	4,700,000.000	4,748,778.410	
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	8,000,000.000	7,933,120.000	



	1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	30,000,000.000	28,218,600.000	
	2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	6,000,000.000	5,364,360.000	
	1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	15,100,000.000	14,855,682.000	
	5.125% Mexico Government International Bond 20200115	8,000,000.000	8,684,000.000	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 74,329,110.410 (8,463,112,512)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	2% United Kingdom Gilt 20200722	2,000,000.000	2,111,200.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,200,000.000	2,293,940.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	4,500,000.000	4,641,300.000	
	5% United Kingdom Gilt 20250307	9,300,000.000	12,187,650.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	1,541,500.000	
	4% United Kingdom Gilt 20220307	1,500,000.000	1,755,750.000	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 24,531,340.000 (3,618,127,337)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	16,500,000.000	18,847,785.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	24,000,000.000	28,238,880.000	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 47,086,665.000 (3,941,153,860)	
カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	2.75% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20220601	2,500,000.000	2,704,175.000	

	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,500,000.000	1,886,640.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	14,000,000.000	14,899,500.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	8,000,000.000	7,996,080.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 27,486,395.000 (2,282,745,105)	
スウェーデン・ クローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	14,000,000.000	16,650,200.000	スウェーデン・クローナ
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	36,500,000.000	39,465,260.000	スウェーデン・クローナ
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 56,115,460.000 (719,961,352)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,500,000.000	9,127,360.000	デンマーク・クローネ
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	43,000,000.000	47,954,030.000	デンマーク・クローネ
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 57,081,390.000 (950,975,958)	
ノルウェー・ク ローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	5,000,000.000	5,547,350.000	ノルウェー・クローネ
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	4,000,000.000	4,171,520.000	ノルウェー・クローネ
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	20,000,000.000	22,118,600.000	ノルウェー・クローネ
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 31,837,470.000 (417,707,606)	
ポーランド・ズ ロチ		ポーランド・ズロチ	ポーランド・ズロチ	

		2.5% Poland Government Bond 20260725	28,000,000.000	26,173,000.000	
		5.75% Poland Government Bond 20211025	46,000,000.000	51,782,200.000	
	ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 77,955,200.000 (2,284,087,360)	
	ユーロ		ユーロ	ユーロ	
		0.8% Belgium Government Bond 20250622	18,500,000.000	18,927,535.000	
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	4,200,000.000	5,475,918.000	
		2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	8,700,000.000	9,878,415.000	
		4.25% Belgium Government Bond 20220928	500,000.000	616,935.000	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,500,000.000	2,155,740.000	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	12,800,000.000	17,446,272.000	
		1% IRISH TREASURY 20260515	8,000,000.000	8,090,320.000	
	ユーロ 小計			ユーロ 62,591,135.000 (7,765,056,208)	
国債証券 合計				30,442,927,298 [30,442,927,298]	
特殊債券	カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル	
		2.55% CANADA HOUSING TRUST 20250315	4,500,000.000	4,738,005.000	
		1.25% CANADA HOUSING TRUST 20210615	5,000,000.000	4,992,650.000	
		2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	7,000,000.000	7,188,860.000	
		2.3% Japan Bank For International Cooperation 20180319	5,000,000.000	5,041,700.000	
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 21,961,215.000 (1,823,878,906)	
特殊債券 合計				1,823,878,906 [1,823,878,906]	
合計				32,266,806,204	

- (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 7銘柄	100%	26.3%
イギリス・ポンド	国債証券 6銘柄	100%	11.2%
オーストラリア・ドル	国債証券 2銘柄	100%	12.2%
カナダ・ドル	国債証券 4銘柄 特殊債券 4銘柄	100%	12.7%
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	100%	2.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	100%	2.9%
ノルウェー・クローネ	国債証券 3銘柄	100%	1.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	100%	7.1%
ユーロ	国債証券 7銘柄	100%	24.1%

## 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。

「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28年11月10日現在	平成29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	1,221,238,770	859,911,171
国債証券	385,485,882,760	358,895,774,290
未収利息	1,698,895,410	1,641,087,262
前払費用	59,170,656	167,193,931
流動資産合計	388,465,187,596	361,563,966,654
資産合計	388,465,187,596	361,563,966,654

負債の部		
流動負債		
未払解約金	143,686,939	103,037,101
その他未払費用	-	2,445
流動負債合計	143,686,939	103,039,546
負債合計	143,686,939	103,039,546
純資産の部		
元本等		
元本	1 308,145,774,092	288,655,416,388
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	80,175,726,565	72,805,510,720
元本等合計	388,321,500,657	361,460,927,108
純資産合計	388,321,500,657	361,460,927,108
負債純資産合計	388,465,187,596	361,563,966,654

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成28年11月11日 至 平成29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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1. 1 期首	平成28年5月11日	平成28年11月11日
期首元本額	336,790,120,056円	308,145,774,092円
期中追加設定元本額	3,982,233,971円	5,208,591,605円
期中一部解約元本額	32,626,579,935円	24,698,949,309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）	10,719,160円	5,270,940円
安定重視ポートフォリオ（奇 数月分配型）	320,349,829円	306,769,487円
6資産バランスファンド（分 配型）	365,521,146円	342,356,550円
6資産バランスファンド（成 長型）	174,967,475円	174,983,226円
ダイワ日本国債ファンド（毎 月分配型）	297,864,291,584円	278,375,211,509円
世界6資産均等分散ファンド （毎月分配型）	117,619,176円	113,627,399円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	53,238,095円	54,841,878円
ダイワ日本国債ファンド（年 1回決算型）	8,928,839,730円	9,013,425,291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）	310,227,897円	268,930,108円
計	308,145,774,092円	288,655,416,388円
2. 期末日における受益権の総数	308,145,774,092口	288,655,416,388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28年11月11日 至 平成29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29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	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 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。</p>

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

種 類	平成28年11月10日現在	平成29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	3,958,281,290	146,740,990
合計	3,958,281,290	146,740,990

(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28年3月11日から平成28年11月10日まで、及び平成29年3月11日から平成29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28年11月10日現在	平成29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28年11月10日現在	平成29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)	1.2602円 (12,602円)	1.2522円 (12,522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	2 8 7 1 0 年国債	2,550,000,000	2,555,559,000	
	2 9 6 1 0 年国債	950,000,000	971,802,500	
	1 3 0 年国債	13,550,000,000	17,896,027,000	
	2 3 0 年国債	420,000,000	537,133,800	
	4 3 0 年国債	17,600,000,000	23,842,544,000	
	5 3 0 年国債	13,800,000,000	17,492,880,000	
	6 3 0 年国債	4,650,000,000	6,047,092,500	
	3 6 利付国債2 0 年	770,000,000	778,708,700	
	3 7 利付国債2 0 年	10,723,000,000	10,848,137,410	
	3 8 利付国債2 0 年	9,526,000,000	9,760,434,860	
	4 0 2 0 年国債	11,742,000,000	12,138,644,760	
	4 2 2 0 年国債	10,248,000,000	10,779,153,840	
	4 3 2 0 年国債	14,172,000,000	15,198,761,400	
	4 4 2 0 年国債	8,035,000,000	8,647,909,800	
	4 6 2 0 年国債	900,000,000	966,285,000	
	4 7 2 0 年国債	5,550,000,000	5,989,615,500	
	4 8 2 0 年国債	11,501,000,000	12,605,211,010	
	4 9 2 0 年国債	3,868,000,000	4,205,096,200	
	5 1 2 0 年国債	2,890,000,000	3,145,620,500	
	5 2 2 0 年国債	4,368,000,000	4,795,234,080	
	5 4 2 0 年国債	10,587,000,000	11,730,501,870	
	5 5 2 0 年国債	4,004,000,000	4,418,734,320	
	5 6 2 0 年国債	8,020,000,000	8,889,047,200	
	5 8 2 0 年国債	6,825,000,000	7,564,488,750	
	5 9 2 0 年国債	5,595,000,000	6,164,682,900	
	6 1 2 0 年国債	1,200,000,000	1,278,108,000	
6 4 2 0 年国債	11,535,000,000	13,003,059,450		



6 8	2 0 年国債	9,475,000,000	10,963,996,250	
7 0	2 0 年国債	10,438,000,000	12,279,367,580	
7 2	2 0 年国債	2,850,000,000	3,303,777,000	
7 4	2 0 年国債	65,000,000	75,615,150	
7 5	2 0 年国債	7,074,000,000	8,260,309,800	
8 0	2 0 年国債	4,723,000,000	5,538,284,260	
8 2	2 0 年国債	8,165,000,000	9,610,286,650	
8 6	2 0 年国債	7,400,000,000	8,903,088,000	
8 8	2 0 年国債	8,460,000,000	10,222,641,000	
9 0	2 0 年国債	1,700,000,000	2,046,188,000	
9 1	2 0 年国債	7,200,000,000	8,733,456,000	
9 2	2 0 年国債	1,370,000,000	1,642,479,300	
9 4	2 0 年国債	1,210,000,000	1,455,388,000	
9 5	2 0 年国債	8,105,000,000	9,943,781,350	
1 0 1	2 0 年国債	11,160,000,000	13,946,205,600	
1 0 2	2 0 年国債	8,570,000,000	10,746,951,400	
1 0 6	2 0 年国債	10,480,000,000	12,951,708,000	
1 1 0	2 0 年国債	340,000,000	418,196,600	
1 1 1	2 0 年国債	4,500,000,000	5,603,580,000	
国債証券 合計			358,895,774,290	
合計			358,895,774,290	

## 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。

## 「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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,671,385,760	2,703,278,665
コール・ローン	862,251,969	794,725,286

投資証券	111,956,581,952	113,909,323,277
派生商品評価勘定	40,133	7,114
未収入金	553,226,692	1,257,651,542
未収配当金	81,836,342	156,628,851
流動資産合計	116,125,322,848	118,821,614,735
資産合計	116,125,322,848	118,821,614,735
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	486,297
未払金	977,199,046	489,092,436
未払解約金	305,000,000	250,697,000
その他未払費用	20,945,781	2,825
流動負債合計	1,303,144,827	740,278,558
負債合計	1,303,144,827	740,278,558
純資産の部		
元本等		
元本	1	63,040,417,330
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	51,781,760,691	62,129,696,427
元本等合計	114,822,178,021	118,081,336,177
純資産合計	114,822,178,021	118,081,336,177
負債純資産合計	116,125,322,848	118,821,614,735

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年11月11日 至 平成29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

	<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>2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法</p>	<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>
<p>3. 収益及び費用の計上基準</p>	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、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>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>	<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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1. 1 期首	平成28年5月11日	平成28年11月11日

期首元本額	69,921,612,480円	63,040,417,330円
期中追加設定元本額	122,415,843円	99,617,849円
期中一部解約元本額	7,003,610,993円	7,188,395,429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)	57,251,305,286円	50,768,148,699円
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	45,444,589円	43,641,144円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	30,852,991円	26,371,212円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	27,951,935円	24,508,322円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	130,931,477円	123,113,562円
6資産バランスファンド(分配型)	246,264,120円	209,895,661円
6資産バランスファンド(成長型)	473,407,991円	436,871,496円
りそなワールド・リート・ファンド	2,536,409,117円	2,262,320,657円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	78,713,866円	69,402,553円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	6,229,521円	6,033,901円
常陽3分法ファンド	360,521,099円	330,686,775円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	82,755,338円	74,950,692円
ダイワ・海外株式&REITファンド(毎月分配型)	23,497,037円	-円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	208,778,460円	202,941,152円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	276,387,096円	275,051,402円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	322,267,223円	331,938,301円

ダイワ・グローバルREIT ファンド（ダイワSMA専 用）	140,427,615円	58,981,399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）	731,873,460円	640,002,801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）	28,730,268円	28,917,508円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド（為替ヘッジなし）	37,668,841円	37,862,513円
計	63,040,417,330円	55,951,639,750円
2. 期末日における受益権の総数	63,040,417,330口	55,951,639,750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28年11月11日 至 平成29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29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28年11月10日現在	平成29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	6,396,131,721	5,467,962,198
合計	6,396,131,721	5,467,962,198

（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28年9月16日から平成28年11月10日まで、及び平成29年3月16日から平成29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28年11月10日 現在				平成29年5月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引  為替予約取引  売 建	270,745,026	-	270,720,139	24,887	478,337,385	-	478,332,771	4,614

アメリカ・ドル	264,049,000	-	264,025,000	24,000	284,622,500	-	284,625,000	2,500
イギリス・ポンド	-	-	-	-	104,930,183	-	104,923,069	7,114
シンガポール・ドル	6,696,026	-	6,695,139	887	-	-	-	-
ユーロ	-	-	-	-	88,784,702	-	88,784,702	0
買建	6,696,026	-	6,711,272	15,246	193,714,885	-	193,231,088	483,797
アメリカ・ドル	6,696,026	-	6,711,272	15,246	193,714,885	-	193,231,088	483,797
合計	277,441,052	-	277,431,411	40,133	672,052,270	-	671,563,859	479,183

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1口当たり純資産額	1.8214円	2.1104円
(1万口当たり純資産額)	(18,214円)	(21,104円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	336,194	10,354,775.200	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	171,684	32,985,646.920	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	201,765	32,778,741.900	
		VORNADO REALTY TRUST	197,164	18,606,366.680	
		EPR PROPERTIES	74,762	5,246,797.160	
		EQUINIX INC	21,158	9,011,403.780	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	288,006	6,333,251.940	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	644,436	11,490,293.880	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	551,703	12,258,840.660	
		GRAMERCY PROPERTY TRUST	278,223	7,581,576.750	
		DUPONT FABROS TECHNOLOGY	19,496	1,004,238.960	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	301,722	10,074,497.580	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	643,490	12,271,354.300	
		CYRUSONE INC	106,284	5,723,393.400	
		STORE CAPITAL CORP	71,215	1,449,937.400	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	445,431	9,264,964.800	
		VENTAS INC	278,405	17,436,505.150	
		GEO GROUP INC/THE	306,070	9,684,054.800	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	714,094	13,653,477.280	
		CROWN CASTLE INTL CORP	106,471	10,109,421.450	
		SUN COMMUNITIES INC	215,149	18,038,092.160	
		PROLOGIS INC	279,745	15,162,179.000	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	68,667	7,795,077.840	
		COUSINS PROPERTIES INC	1,291,472	10,745,047.040	
		DUKE REALTY CORP	554,136	15,449,311.680	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	108,019	27,051,198.170	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	75,084	9,802,216.200	
		KILROY REALTY CORP	167,780	11,754,666.800	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	234,842	7,679,333.400	
PUBLIC STORAGE	59,265	12,331,268.550			
SL GREEN REALTY CORP	184,598	19,105,893.000			
UDR INC	737,671	27,699,546.050			
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	644,969	9,997,019.500			
DIGITAL REALTY TRUST INC	116,249	13,252,386.000			
EXTRA SPACE STORAGE INC	283,857	20,761,300.980			
EDUCATION REALTY TRUST INC	390,320	14,633,096.800			



	DOUGLAS EMMETT INC	323,563	12,392,462.900	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 490,969,636.060 (55,901,802,762)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	14,530,014	8,885,103.560	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	8,516,589	5,216,410.760	
	SEGRO PLC	7,073,522	35,311,021.820	
	UNITE GROUP PLC	742,207	4,779,813.080	
	WORKSPACE GROUP PLC	883,104	7,713,913.440	
	BIG YELLOW GROUP PLC	2,225,984	17,785,612.160	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	4,647,832	7,836,244.750	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	2,868,272	4,124,575.130	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 91,652,694.700 (13,517,855,941)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	NATIONAL STORAGE REIT	13,452,587	19,842,565.820	
	SCENTRE GROUP	4,725,082	20,034,347.680	
	DEXUS	5,465,486	55,966,576.640	
	INVESTA OFFICE FUND	4,501,466	21,517,007.480	
	MIRVAC GROUP	10,625,600	24,545,136.000	
	GOODMAN GROUP	5,916,411	48,692,062.530	
	CHARTER HALL GROUP	1,389,017	8,139,639.620	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	7,003,818	19,190,461.320	
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 217,927,797.090 (18,240,556,616)	
カナダ・ドル			カナダ・ドル	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	501,527	19,083,102.350	
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 19,083,102.350 (1,584,851,651)	
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル	
	KEPPEL DC REIT	20,827,413	25,930,129.180	
	CAPITALAND MALL TRUST	3,604,900	7,065,604.000	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	6,530,100	13,125,501.000	

	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	2,894,400	7,438,608.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 53,559,842.180 (4,323,886,060)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	2,001,179	24,964,708.020	ユーロ
	EUROCOMMERCIAL PROPRTIE-CV	114,515	4,292,022.200	
	GECINA SA	196,051	26,741,356.400	
	KLEPIERRE	961,748	36,108,828.660	
	AEDIFICA	73,709	5,449,306.370	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	56,383	5,055,299.780	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	375,661	5,499,677.040	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	1,815,596	20,298,363.280	
ユーロ 小計			ユーロ 128,409,561.750 (15,930,490,230)	
香港・ドル	FORTUNE REIT	15,114,070	136,782,333.500	香港・ドル
	LINK REIT	2,908,920	164,644,872.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 301,427,205.500 (4,409,880,017)	
投資証券 合計			113,909,323,277 [113,909,323,277]	
合計			113,909,323,277 [113,909,323,277]	

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 37銘柄	100%	49.0%
イギリス・ポンド	投資証券 8銘柄	100%	11.9%
オーストラリア・ドル	投資証券 8銘柄	100%	16.0%
カナダ・ドル	投資証券 1銘柄	100%	1.4%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	3.8%
ユーロ	投資証券 8銘柄	100%	14.0%

香港・ドル	投資証券	2銘柄	100%	3.9%
-------	------	-----	------	------

## 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

「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。

## 「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成28年11月10日現在	平成29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	698,474,465	1,475,147,790
投資証券	73,260,281,500	80,183,420,000
未収入金	231,936,398	23,905,930
未収配当金	658,684,675	717,814,140
流動資産合計	74,849,377,038	82,400,287,860
資産合計	74,849,377,038	82,400,287,860
負債の部		
流動負債		
未払金	-	236,332,831
未払解約金	9,160,000	11,900,000
その他未払費用	-	7,080
流動負債合計	9,160,000	248,239,911
負債合計	9,160,000	248,239,911
純資産の部		
元本等		
元本	1 32,390,535,874	34,318,648,308
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	42,449,681,164	47,833,399,641
元本等合計	74,840,217,038	82,152,047,949
純資産合計	74,840,217,038	82,152,047,949
負債純資産合計	74,849,377,038	82,400,287,860

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年11月11日 至 平成29年5月10日	
	1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</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. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1. 1 期首	平成28年5月11日	平成28年11月11日
期首元本額	33,041,891,516円	32,390,535,874円
期中追加設定元本額	1,811,707,238円	3,003,449,784円
期中一部解約元本額	2,463,062,880円	1,075,337,350円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	24,064,378円	22,851,019円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	22,304,762円	20,672,094円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	105,471,338円	105,047,782円
6資産バランスファンド（分配型）	196,218,407円	181,007,537円
6資産バランスファンド（成長型）	377,131,374円	373,508,065円

世界6資産均等分散ファンド (毎月分配型)	62,749,137円	59,431,666円
『しがぎん』SRI三資産バ ランス・オープン(奇数月分 配型)	2,504,007円	2,504,007円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	65,907,260円	64,289,232円
成果リレー(ブラジル国債& J-REIT)2014-07	59,428,134円	40,814,948円
成果リレー(ブラジル国債& J-REIT)2014-08	59,775,196円	46,890,875円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	163,397,907円	176,563,932円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	218,076,392円	239,927,724円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	254,966,202円	287,403,351円
DCダイワJ-REITアク ティブファンド	479,157,262円	459,950,641円
ダイワファンドラップJ- REITセレクト	29,112,574,581円	31,062,972,224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)	148,990,477円	147,041,493円
ライフハーモニー(ダイワ世 界資産分散ファンド)(安定 型)	44,780,998円	43,581,508円
ライフハーモニー(ダイワ世 界資産分散ファンド)(分配 型)	240,357,193円	231,791,381円
ダイワ・アクティブJリー ト・ファンド(年4回決算 型)	752,680,869円	752,398,829円
計	32,390,535,874円	34,318,648,308円
2. 期末日における受益権の総数	32,390,535,874口	34,318,648,308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28年11月11日 至 平成29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29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28年11月10日現在	平成29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	7,042,953,969	1,071,228,251
合計	7,042,953,969	1,071,228,251

(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28年5月11日から平成28年11月10日まで、及び平成28年11月11日から平成29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28年11月10日現在	平成29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28年11月10日現在	平成29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)	2,3106円 (23,106円)	2,3938円 (23,938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	1,456,500,000	
	MCUBS MidCity投資法人	2,000	686,000,000	
	森ヒルズリート	18,000	2,624,400,000	
	産業ファンド	3,000	1,503,000,000	
	アドバンス・レジデンス	8,000	2,384,000,000	
	ケネディクスレジデンシャル	4,000	1,170,800,000	
	API投資法人	6,000	3,192,000,000	
	GLP投資法人	20,000	2,592,000,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	6,000	1,510,200,000	
	日本プロロジスリート	13,000	3,148,600,000	
	星野リゾート・リート	1,000	579,000,000	
	SIA不動産投資	3,000	579,300,000	
	イオンリート投資	15,000	1,870,500,000	
	ヒューリックリート投資法	7,000	1,293,600,000	
	日本リート投資法人	2,000	581,200,000	
	インベスコ・オフィス・Jリート	6,000	601,800,000	
	積水ハウス・リート投資	10,000	1,433,000,000	
ケネディクス商業リート	6,000	1,500,600,000		

野村不動産マスターF	27,000	4,414,500,000	
ラサールロジポート投資	7,000	749,000,000	
三井不ロジパーク	1,000	337,500,000	
大江戸温泉リート	8,000	722,400,000	
投資法人みらい	2,000	309,400,000	
日本ビルファンド	8,500	5,253,000,000	
ジャパンリアルエステイト	9,500	5,766,500,000	
日本リテールファンド	15,000	3,319,500,000	
オリックス不動産投資	20,000	3,576,000,000	
日本プライムリアルティ	4,000	1,720,000,000	
プレミアム投資法人	9,000	1,116,000,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	3,000	1,177,500,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	16,000	2,731,200,000	
森トラスト総合リート	4,000	713,600,000	
インヴィンシブル投資法人	16,000	746,400,000	
フロンティア不動産投資	4,000	2,004,000,000	
平和不動産リート	8,000	690,400,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	4,900	1,165,220,000	
福岡リート投資法人	7,000	1,248,800,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	4,000	2,588,000,000	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	10,000	1,193,000,000	
いちごオフィスリート投資法人	8,000	536,000,000	
大和証券オフィス投資法人	2,400	1,375,200,000	
阪急リート投資法人	2,000	301,800,000	
大和ハウスリート投資法人	11,000	3,163,600,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	30,000	2,322,000,000	
日本賃貸住宅投資法人	14,000	1,145,200,000	
ジャパンエクセレント投資法人	8,000	1,091,200,000	
投資証券 合計		80,183,420,000	
合計		80,183,420,000	

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。



「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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	62,787,184	49,878,079
コール・ローン	23,368,014	28,367,677
株式	1,451,132,292	1,525,721,747
ハイブリッド優先証券	398,255,347	457,237,922
投資証券	42,562,437	45,182,019
未収入金	19,357,404	40,931,934
未収配当金	3,128,200	2,144,938
未収利息	1,099,729	864,150
流動資産合計	2,001,690,607	2,150,328,466
資産合計	2,001,690,607	2,150,328,466
負債の部		
流動負債		
未払金	22,488,999	42,465,518
未払解約金	35,000	1,209,000
その他未払費用	-	138
流動負債合計	22,523,999	43,674,656
負債合計	22,523,999	43,674,656
純資産の部		
元本等		
元本	1,000,756,551	891,301,312
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	978,410,057	1,215,352,498
元本等合計	1,979,166,608	2,106,653,810
純資産合計	1,979,166,608	2,106,653,810
負債純資産合計	2,001,690,607	2,150,328,466

#### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年11月11日 至 平成29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。</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>(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	為替予約取引

<p>3. 収益及び費用の計上基準</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> <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>
<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>	<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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1. 1 期首	平成28年5月11日	平成28年11月11日
期首元本額	998,308,163円	1,000,756,551円
期中追加設定元本額	56,163,166円	16,062,304円
期中一部解約元本額	53,714,778円	125,517,543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）	19,209,803円	15,592,169円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	17,920,382円	14,365,197円

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	306,186,820円	258,897,305円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	51,640,670円	44,241,599円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	53,272,780円	44,740,133円
米国好配当株オープン（予想分配金提示型）	508,364円	480,845円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	92,149,218円	84,059,568円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	186,913,331円	171,557,194円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	272,955,183円	257,367,302円
計	1,000,756,551円	891,301,312円
2. 期末日における受益権の総数	1,000,756,551口	891,301,312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28年11月11日 至 平成29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29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28年11月10日現在	平成29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	32,993,029	45,494,815
ハイブリッド優先証券	9,742,335	3,715,790
投資証券	517,656	24,364
合計	22,733,038	49,234,969

(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28年10月18日から平成28年11月10日まで、及び平成29年4月18日から平成29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28年11月10日現在	平成29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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1口当たり純資産額	1.9777円	2.3636円
(1万口当たり純資産額)	(19,777円)	(23,636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	
	ABBOTT LABORATORIES	4,555	44.670	203,471.850	
	AETNA INC	3,000	142.400	427,200.000	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	725	145.300	105,342.500	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	2,000	131.910	263,820.000	
	ALLIANT ENERGY CORP	1,686	39.570	66,715.020	
	TE CONNECTIVITY LTD	3,153	75.810	239,028.930	
	APPLE INC	3,700	153.990	569,763.000	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,010	60.700	61,307.000	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,500	46.420	162,470.000	
	BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,095	55.320	171,215.400	
	JPMORGAN CHASE & CO	3,792	86.750	328,956.000	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,000	128.910	128,910.000	
	FIRST AMERICAN FINANCIAL	5,026	41.780	209,986.280	
	CISCO SYSTEMS INC	7,200	33.900	244,080.000	
	MORGAN STANLEY	4,537	42.830	194,319.710	
	BROADCOM LTD	763	228.460	174,314.980	
	TELEFLEX INC	450	194.400	87,480.000	
	LYONDELLBASELL INDU-CL A	900	81.910	73,719.000	
	KINDER MORGAN INC	5,900	19.900	117,410.000	
	EXPEDIA INC	1,637	139.400	228,197.800	
	EXXON MOBIL CORP	2,853	82.310	234,830.430	
	NEXTERA ENERGY INC	1,825	133.770	244,130.250	
	GENERAL ELECTRIC CO	5,800	28.930	167,794.000	
	GENERAL DYNAMICS CORP	1,044	196.590	205,239.960	
	ALPHABET INC-CL A	550	956.710	526,190.500	
	FIFTH THIRD BANCORP	4,000	24.840	99,360.000	
HOME DEPOT INC	853	157.680	134,501.040		
HUNTINGTON BANCSHARES INC	7,700	12.930	99,561.000		
HELMERICH & PAYNE	1,100	58.180	63,998.000		
JOHNSON & JOHNSON	1,696	123.210	208,964.160		
LINCOLN NATIONAL CORP	1,400	68.610	96,054.000		
NORTHROP GRUMMAN CORP	810	249.490	202,086.900		

	DELPHI AUTOMOTIVE PLC	1,534	88.270	135,406.180	
	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2,600	59.880	155,688.000	
	ALTRIA GROUP INC	4,800	70.290	337,392.000	
	PFIZER INC	8,200	33.380	273,716.000	
	PROCTER & GAMBLE CO/THE	3,341	86.400	288,662.400	
	ACCENTURE PLC-CL A	2,700	121.070	326,889.000	
	SCHLUMBERGER LTD	1,468	72.280	106,107.040	
	AT&T INC	5,600	38.220	214,032.000	
	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,388	106.510	254,345.880	
	ANTHEM INC	1,185	177.730	210,610.050	
	WALT DISNEY CO/THE	2,000	112.070	224,140.000	
	WELLS FARGO & CO	5,400	54.680	295,272.000	
	ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	1,700	118.660	201,722.000	
	WESTERN DIGITAL CORP	798	88.880	70,926.240	
	PPG INDUSTRIES INC	1,800	107.850	194,130.000	
	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,400	121.960	170,744.000	
	TYSON FOODS INC-CL A	1,727	57.880	99,958.760	
	NOBLE ENERGY INC	4,300	31.090	133,687.000	
	BANK OF AMERICA CORP	17,402	23.980	417,299.960	
	ANALOG DEVICES INC	3,000	78.500	235,500.000	
	EATON CORP PLC	3,000	76.760	230,280.000	
	GILEAD SCIENCES INC	3,000	67.610	202,830.000	
	INTEL CORP	6,612	36.370	240,478.440	
	HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	3,440	49.260	169,454.400	
	MICROSOFT CORP	5,941	69.040	410,166.640	
	CVS HEALTH CORP	2,939	81.100	238,352.900	
	MEDTRONIC PLC	1,307	83.340	108,925.380	
	BLACKROCK INC	258	380.500	98,169.000	
	CHUBB LTD	1,480	136.320	201,753.600	
	STARBUCKS CORP	3,500	60.980	213,430.000	
	VIACOM INC-CLASS B	4,508	36.230	163,324.840	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 12,963,811.420 (1,476,059,569)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	SUNCOR ENERGY INC	3,400	43.110	146,574.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	944	92.940	87,735.360	
	MAGNA INTERNATIONAL INC	3,291	58.900	193,839.900	

	ENBRIDGE INC	3,000	56.610	169,830.000	
カナダ・ドル	小計			カナダ・ドル 597,979.260 (49,662,178)	
合計				1,525,721,747 [1,525,721,747]	

## (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	86,720.000	
		CHS INC 7.5 4	4,900.000	142,884.000	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA	5,225.000	141,597.500	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.2 F	2,475.000	66,528.000	
		WELLS FARGO & COMPANY 6 V	4,177.000	109,896.870	
		SOUTHERN CO 6.25	3,304.000	88,315.920	
		AMERICAN FINANCIAL GROUP 6	1,500.000	40,365.000	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.7 W	1,979.000	50,167.650	
		BANK OF AMERICA CORP 6.2 CC	5,282.000	138,018.660	
		CITIGROUP INC 6.3 S	5,600.000	148,400.000	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.3 N	1,973.000	53,034.240	
		EBAY INC 6	666.000	17,695.620	
		BERKLEY (WR) CORPORATION 5.9	3,550.000	92,442.000	
		CHARLES SCHWAB CORP 5.95 D	1,000.000	27,120.000	
		SCE TRUST V 5.45 K	1,000.000	29,090.000	
		HUNTINGTON BANCSHARES 6.25 D	1,775.000	48,581.750	
		STATE STREET CORP 5.35 G	1,038.000	27,808.020	
		BANK OF AMERICA CORP 6 EE	4,980.000	129,280.800	
		BERKLEY (WR) CORPORATION 5.75	2,100.000	53,025.000	
		VALIDUS HOLDINGS LTD 5.875 A	725.000	18,270.000	
		REINSURANCE GRP OF AMER 5.75	700.000	19,411.000	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.5 X	2,480.000	62,148.800	



STIFEL FINANCIAL CORP 6.25 A	2,023.000	53,285.820	
DOMINION RESOURCES INC 5.25 A	1,536.000	37,739.520	
CAPITAL ONE FINANCIAL CO 5.2 G	1,500.000	35,565.000	
LEGG MASON INC 5.45	3,375.000	80,662.500	
QWEST CORP 6.5	1,089.000	27,159.660	
ASPEN INSURANCE HLDG LTD 5.625 *	5,175.000	127,512.000	
ARCH CAPITAL GROUP LTD 5.25 E	3,800.000	88,350.000	
PEOPLE'S UNITED FIN INC 5.625 A	1,160.000	31,807.200	
MORGAN STANLEY 5.85 K	6,800.000	179,248.000	
DTE ENERGY CO 6 F	5,025.000	131,856.000	
AXIS CAPITAL HLDGS LTD 5.5 E	1,575.000	38,130.750	
NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A.	7,025.000	195,857.000	
NUSTAR ENERGY LP 7.625 B	1,775.000	44,623.500	
NEXTERA ENERGY CAPITAL 5.7 G	1,750.000	44,520.000	
BANK OF AMERICA CORP 6.5 Y	4,200.000	112,686.000	
HANOVER INSURANCE GROUP 6.35	2,100.000	53,508.000	
CITIGROUP INC 6.875 K	2,414.000	70,609.500	
PARTNERRE LTD 6.5 G	4,576.000	123,689.280	
MORGAN STANLEY 6.875 F	2,707.000	79,504.590	
ALLY FINANCIAL 6.82400 2/15/40	6,575.000	168,648.750	
PNC FINANCIAL SERVICES 6.125 P	700.000	20,468.000	
BB&T CORPORATION 5.85	1,000.000	25,600.000	
BANK OF AMERICA CORP 6.625 W	2,570.000	69,826.900	
ALLSTATE CORP 6.625 E	650.000	17,771.000	
GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.375 K	900.000	25,785.000	
QWEST CORP 7	600.000	15,174.000	

		MORGAN STANLEY 6.625 G	1,500.000	40,875.000	
		MORGAN STANLEY 6.375 I	3,325.000	93,033.500	
		NUSTAR LOGISTICS LP 7.625	2,500.000	63,900.000	
		STATE STREET CORP 5.9 D	2,350.000	67,492.000	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.85	2,597.000	70,872.130	
		CITIGROUP INC 7.125 J	3,763.000	111,648.210	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.3 W	700.000	19,285.000	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.7 D	2,100.000	58,296.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 4,015,790.640 (457,237,922)	
ハイブリッド優先証券 合計				457,237,922 [457,237,922]	
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS 6.95 E	793	20,308.730	
		AMERICAN HOMES 4 RENT 6.5 D	563	14,429.690	
		AMERICAN HOMES 4 RENT 6.35 E	1,500	38,100.000	
		PUBLIC STORAGE 4.9 E	750	17,512.500	
		COLONY NORTHSTAR INC 8.75 E	1,750	45,972.500	
		NATL RETAIL PROPERTIES 5.7 E	800	20,608.000	
		RETAIL PROPERTIES OF AME 7 A	2,000	52,000.000	
		GRAMERCY PROPERTY TRUST 7.125 A	1,700	45,220.000	
		DDR CORP 6.5 J	1,000	25,060.000	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST 7.75 A	710	18,133.400	
		VEREIT INC 6.7 F	3,826	99,476.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 396,820.820 (45,182,019)	
投資証券 合計				45,182,019 [45,182,019]	
合計				502,419,941 [502,419,941]	

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	63銘柄	74.6%	23.1%	2.3%	
	ハイブリッ ド優先証券	56銘柄				
	投資証券	11銘柄				
カナダ・ドル	株式	4銘柄	100%	-%	-%	2.4%

## 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

該当事項はありません。

「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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	37,828,046	24,051,753
コール・ローン	17,413,948	18,872,735
株式	1,231,122,951	1,333,129,796
派生商品評価勘定	10,234	-
未収入金	11,967,954	1,183,413
未収配当金	1,549,464	3,198,893
流動資産合計	1,299,892,597	1,380,436,590
資産合計	1,299,892,597	1,380,436,590

負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	59,432	-
未払金	26,084,992	-
未払解約金	122,000	2,006,000
その他未払費用	-	37
流動負債合計	26,266,424	2,006,037
負債合計	26,266,424	2,006,037
純資産の部		
元本等		
元本	1	961,901,106
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	311,725,067	534,367,217
元本等合計	1,273,626,173	1,378,430,553
純資産合計	1,273,626,173	1,378,430,553
負債純資産合計	1,299,892,597	1,380,436,590

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成28年11月11日 至 平成29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。</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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1. 1 期首	平成28年5月11日	平成28年11月11日
期首元本額	964,995,168円	961,901,106円
期中追加設定元本額	39,297,176円	13,987,439円
期中一部解約元本額	42,391,238円	131,825,209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）	28,264,443円	23,591,043円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	26,257,388円	21,582,556円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	450,267,648円	384,883,563円

ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	76,252,353円	64,918,061円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	79,391,003円	67,215,546円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	50,499,933円	46,036,978円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	101,935,462円	94,542,146円
DCダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	149,032,876円	141,293,443円
計	961,901,106円	844,063,336円
2. 期末日における受益権の総数	961,901,106口	844,063,336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28年11月11日 至 平成29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29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28年11月10日現在	平成29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	1,223,950	50,525,258
合計	1,223,950	50,525,258

（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28年10月18日から平成28年11月10日まで、及び平成29年4月18日から平成29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28年11月10日 現在				平成29年5月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	38,088,432	-	38,087,521	911	-	-	-	-
イギリス・ポンド	11,967,954	-	11,967,043	911	-	-	-	-
ユーロ	26,120,478	-	26,120,478	0	-	-	-	-
買 建	43,851,109	-	43,801,000	50,109	-	-	-	-

スイス・フラン	26,120,478	-	26,084,991	35,487	-	-	-	-
ユーロ	17,730,631	-	17,716,009	14,622	-	-	-	-
合計	81,939,541	-	81,888,521	49,198	-	-	-	-

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	平成28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1口当たり純資産額	1.3241円	1.6331円
(1万口当たり純資産額)	(13,241円)	(16,331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・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	PRUDENTIAL PLC	14,844	17.500	259,770.000	
	AVIVA PLC	40,669	5.355	217,782.490	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	15,900	16.000	254,400.000	
	DIXONS CARPHONE PLC	43,909	3.252	142,792.060	
	VODAFONE GROUP PLC	90,005	2.051	184,645.250	



	KINGFISHER PLC	46,778	3.427	160,308.200	
	NATIONAL GRID PLC	22,159	10.320	228,680.880	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	6,383	53.100	338,937.300	
	HSBC HOLDINGS PLC	43,404	6.649	288,593.190	
	CARNIVAL PLC	3,111	48.290	150,230.190	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	11,761	20.910	245,922.510	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 2,472,062.070 (364,604,435)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	1,029	272.600	280,505.400	
	NESTLE SA-REG	6,157	80.950	498,409.150	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,157	278.500	322,224.500	
	NOVARTIS AG-REG	5,149	79.150	407,543.350	
	GIVAUDAN-REG	138	1,961.000	270,618.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 1,779,300.400 (201,238,875)	
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	
	NORDEA BANK AB	18,077	112.100	2,026,431.700	
	SWEDBANK AB - A SHARES	12,350	215.900	2,666,365.000	
	SVENSKA CELLULOSA AB SCA-B	6,228	296.700	1,847,847.600	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 6,540,644.300 (83,916,466)	
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	146.200	2,087,882.200	
ノルウェー・クローネ 小計				ノルウェー・クローネ 2,087,882.200 (27,393,015)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	SIEMENS AG-REG	2,489	131.650	327,676.850	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,996	89.530	268,231.880	
	BASF SE	3,829	89.930	344,341.970	
	ALLIANZ SE-REG	1,619	173.550	280,977.450	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,183	177.200	209,627.600	

DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	21,145	16.855	356,398.970	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	8,394	33.000	277,002.000	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	11,176	19.550	218,490.800	
KONINKLIJKE DSM NV	3,798	65.520	248,844.960	
KONINKLIJKE KPN NV	63,342	2.879	182,361.610	
TOTAL SA	6,299	47.825	301,249.670	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	4,676	71.180	332,837.680	
BNP PARIBAS	5,060	66.660	337,299.600	
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,463	54.450	188,560.350	
SANOFI	3,682	89.980	331,306.360	
INTESA SANPAOLO	57,262	2.848	163,082.170	
ENI SPA	13,923	14.740	205,225.020	
ENEL SPA	41,093	4.550	186,973.150	
ENAGAS SA	10,115	25.345	256,364.670	
NOKIA OYJ	47,705	5.675	270,725.870	
ユーロ 小計			ユーロ 5,287,578.630 (655,977,005)	
合計			1,333,129,796 [1,333,129,796]	

## (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 11銘柄	100%	27.3%
スイス・フラン	株式 5銘柄	100%	15.1%
スウェーデン・クローナ	株式 3銘柄	100%	6.3%
ノルウェー・クローネ	株式 1銘柄	100%	2.1%
ユーロ	株式 20銘柄	100%	49.2%

## 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。

「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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	31,077,644	8,044,891
コール・ローン	19,295,932	7,294,950
株式	832,932,742	926,736,487
投資証券	-	32,767,295
派生商品評価勘定	15,600	-
未収入金	74,470,320	38,774,750
未収配当金	1,250,297	2,230,947
流動資産合計	959,042,535	1,015,849,320
資産合計	959,042,535	1,015,849,320
負債の部		
流動負債		
未払金	47,030,298	22,000,398
未払解約金	-	6,185,000
その他未払費用	-	30
流動負債合計	47,030,298	28,185,428
負債合計	47,030,298	28,185,428
純資産の部		
元本等		
元本	1 518,006,689	470,828,997
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	394,005,548	516,834,895
元本等合計	912,012,237	987,663,892
純資産合計	912,012,237	987,663,892
負債純資産合計	959,042,535	1,015,849,320

#### 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年11月11日 至 平成29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。</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>(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、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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1. 1 期首	平成28年5月11日	平成28年11月11日
期首元本額	569,418,886円	518,006,689円
期中追加設定元本額	7,809,176円	3,083,716円
期中一部解約元本額	59,221,373円	50,261,408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）	20,220,541円	17,692,034円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	19,504,702円	16,452,567円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	325,620,505円	294,023,628円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	53,840,124円	49,849,369円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	56,705,978円	50,707,422円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	7,094,931円	6,893,020円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	14,218,839円	14,089,966円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	20,801,069円	21,120,991円
計	518,006,689円	470,828,997円

2. 期末日における受益権の総数	518,006,689口	470,828,997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28年11月11日 至 平成29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29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28年11月10日現在	平成29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	36,658,873	33,695,404
投資証券	-	414,315
合計	36,658,873	33,281,089

(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28年10月18日から平成28年11月10日まで、及び平成29年4月18日から平成29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28年11月10日 現在				平成29年5月10日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
買 建	9,795,500	-	9,811,100	15,600	-	-	-	-
シンガポール・ドル	9,795,500	-	9,811,100	15,600	-	-	-	-
合計	9,795,500	-	9,811,100	15,600	-	-	-	-

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

- ・ 期末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成28年11月10日現在	平成29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)	1.7606円 (17,606円)	2.0977円 (20,977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	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	株 1,700	アメリカ・ドル 120.000	アメリカ・ドル 204,000.000	
	TARENA INTERNATIONAL INC- ADR	5,700	19.500	111,150.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 315,150.000 (35,882,979)	
オーストラリア・ドル	BHP BILLITON LIMITED	株 9,600	オーストラリア・ドル 23.160	オーストラリア・ドル 222,336.000	
	SOUTH32 LTD	13,000	2.730	35,490.000	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	6,000	32.340	194,040.000	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	14,000	11.790	165,060.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	10,400	32.420	337,168.000	
	CYBG PLC - CDI	5,100	5.000	25,500.000	
	WESTPAC BANKING CORP	9,000	32.880	295,920.000	
	AUST AND NZ BANKING GROUP	8,200	29.160	239,112.000	
	RIO TINTO LTD	2,000	58.790	117,580.000	
	AMCOR LIMITED	22,500	15.470	348,075.000	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	13,000	12.930	168,090.000	



	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	3,473	82.020	284,855.460	
	QBE INSURANCE GROUP LTD	9,500	12.980	123,310.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	2,300	92.460	212,658.000	
	BORAL LTD	23,500	6.500	152,750.000	
	CHALLENGER LTD	25,500	13.450	342,975.000	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 3,264,919.460 (273,273,759)	
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	7,200	20.500	147,600.000	
	KEPPEL CORP LTD	24,000	6.630	159,120.000	
	MM2 ASIA LTD	680,000	0.530	360,400.000	
	JUMBO GROUP LTD	200,000	0.680	136,000.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	160,000	1.100	176,000.000	
	SINGAPORE TECH ENGINEERING	51,000	3.850	196,350.000	
	ROTARY ENGINEERING LTD	44,000	0.380	16,720.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 1,192,190.000 (96,245,499)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	SK HYNIX INC	2,200	56,900.000	125,180,000.000	
	WONIK IPS CO LTD	4,200	27,250.000	114,450,000.000	
	E-MART INC	490	241,000.000	118,090,000.000	
	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	2,100	49,850.000	104,685,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	280	2,351,000.000	658,280,000.000	
	HUCHEMS FINE CHEMICAL CORP	7,100	24,000.000	170,400,000.000	
	HANA FINANCIAL GROUP	6,600	41,700.000	275,220,000.000	
韓国・ウォン 小計				韓国・ウォン 1,566,305,000.000 (157,257,022)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	150,000	6.230	934,500.000	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	17,000	119.600	2,033,200.000	
	TENCENT HOLDINGS LTD	6,000	250.800	1,504,800.000	
	ZTE CORP-H	80,000	14.420	1,153,600.000	
	DATANG INTL POWER GEN CO-H	300,000	2.590	777,000.000	

	CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT	86,000	11.240	966,640.000	
	AIA GROUP LTD	27,000	55.400	1,495,800.000	
	AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS IN	11,000	109.700	1,206,700.000	
	SUNNY OPTICAL TECH	27,000	64.600	1,744,200.000	
	YESTAR HEALTHCARE HOLDINGS	579,000	3.800	2,200,200.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 14,016,640.000 (205,063,444)	
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル	
	GENERAL INTERFACE SOLUTION	14,000	205.500	2,877,000.000	
	PRIMAX ELECTRONICS LTD	66,000	54.900	3,623,400.000	
	ALL RING TECH CO LTD	48,000	74.500	3,576,000.000	
	CHROMA ATE INC	45,000	91.500	4,117,500.000	
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	80,000	48.950	3,916,000.000	
	BIZLINK HOLDING INC	17,000	190.000	3,230,000.000	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	82,000	203.500	16,687,000.000	
	HON HAI PRECISION INDUSTRY	41,000	104.000	4,264,000.000	
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 42,290,900.000 (159,013,784)	
合計				926,736,487 [926,736,487]	

## (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	オーストラリア・ドル	MIRVAC GROUP	100,000	231,000.000	
		GOODMAN GROUP	19,500	160,485.000	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 391,485.000 (32,767,295)	
投資証券 合計				32,767,295 [32,767,295]	
合計				32,767,295 [32,767,295]	

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 投資証券 時価比率	合計金額に 対する比率
アメリカ・ドル	株式 2銘柄	100%	-%	3.7%
オーストラリア・ドル	株式 16銘柄 投資証券 2銘柄	89.3%	10.7%	31.9%
シンガポール・ドル	株式 7銘柄	100%	-%	10.0%
韓国・ウォン	株式 7銘柄	100%	-%	16.4%
香港・ドル	株式 10銘柄	100%	-%	21.4%
台湾・ドル	株式 8銘柄	100%	-%	16.6%

## 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。

「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28年11月10日現在	平成29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	590,575,298	1,261,523,489
株式	36,663,453,700	33,565,794,500
投資証券	1,123,717,200	45,910,000
未収入金	248,874,793	280,039,297
未収配当金	354,017,475	420,038,500
流動資産合計	38,980,638,466	35,573,305,786
資産合計	38,980,638,466	35,573,305,786
負債の部		
流動負債		

未払金		74,753,399	96,419,682
未払解約金		29,403,000	81,367,000
その他未払費用		-	5,894
流動負債合計		104,156,399	177,792,576
負債合計		104,156,399	177,792,576
純資産の部			
元本等			
元本	1	17,213,915,935	13,526,788,046
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		21,662,566,132	21,868,725,164
元本等合計		38,876,482,067	35,395,513,210
純資産合計		38,876,482,067	35,395,513,210
負債純資産合計		38,980,638,466	35,573,305,786

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成28年11月11日 至 平成29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>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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1. 1 期首	平成28年5月11日	平成28年11月11日
期首元本額	18,896,749,108円	17,213,915,935円
期中追加設定元本額	542,257,780円	355,241,907円
期中一部解約元本額	2,225,090,953円	4,042,369,796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	3,449,041,181円	3,306,174,017円
（FOFs用）（適格機関投資家専用）		
ダイワ好配当日本株投信（季節点描）	11,853,588,179円	8,493,103,310円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	40,309,645円	34,934,471円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	50,710,086円	42,773,404円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	47,396,972円	39,499,978円

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	799,367,266円	701,905,867円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	141,139,733円	121,040,889円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	139,472,051円	120,509,807円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	115,794,694円	108,677,294円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	234,115,969円	223,786,297円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	342,980,159円	334,382,712円
計	17,213,915,935円	13,526,788,046円
2. 期末日における受益権の総数	17,213,915,935口	13,526,788,046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28年11月11日 至 平成29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。
--------------------------------	--

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29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28年11月10日現在	平成29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	876,312,609	2,741,730,655
投資証券	11,006,000	735,000
合計	887,318,609	2,742,465,655

(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28年10月18日から平成28年11月10日まで、及び平成29年4月18日から平成29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28年11月10日現在	平成29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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1口当たり純資産額	2.2584円	2.6167円
(1万口当たり純資産額)	(22,584円)	(26,167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	
ミライト・ホールディングス	30,000	1,179.00	35,370,000	
三井松島	50,000	1,504.00	75,200,000	
日成ビルド工業	240,000	583.00	139,920,000	
大和ハウス	132,500	3,547.00	469,977,500	
協和エクシオ	50,000	1,835.00	91,750,000	
九電工	17,500	3,670.00	64,225,000	
日揮	40,000	1,775.00	71,000,000	
トラスト・テック	90,000	2,128.00	191,520,000	
G C A	140,000	938.00	131,320,000	
システナ	1,000	2,169.00	2,169,000	
ディー・エヌ・エー	85,000	2,555.00	217,175,000	
日本たばこ産業	50,000	3,791.00	189,550,000	
アルコニックス	110,000	1,996.00	219,560,000	
東洋紡	100,000	198.00	19,800,000	
シキボウ	550,000	141.00	77,550,000	
アーバネットコーポレーション	160,000	429.00	68,640,000	
サムティ	180,000	1,163.00	209,340,000	
ユニゾホールディングス	42,500	3,075.00	130,687,500	
東急不動産HD	150,000	628.00	94,200,000	
ケー・エフ・シー	47,800	2,240.00	107,072,000	
SUMCO	175,000	1,963.00	343,525,000	
グリー	120,000	874.00	104,880,000	
SRAホールディングス	32,500	3,125.00	101,562,500	
住友化学	475,000	645.00	306,375,000	
神島化学	110,000	2,017.00	221,870,000	
デンカ	340,000	588.00	199,920,000	
信越化学	40,000	9,871.00	394,840,000	
三井化学	550,000	597.00	328,350,000	
宇部興産	350,000	264.00	92,400,000	
武田薬品	40,000	5,489.00	219,560,000	
エーザイ	10,000	5,994.00	59,940,000	
大塚ホールディングス	5,000	5,153.00	25,765,000	
大日本塗料	450,000	269.00	121,050,000	
日本特殊塗料	40,000	1,766.00	70,640,000	



D I C	30,000	4,145.00	124,350,000
日本ハウズイング	9,800	3,095.00	30,331,000
ポーラ・オルビスHD	50,000	2,720.00	136,000,000
日本農薬	150,000	740.00	111,000,000
J X T Gホールディングス	950,000	512.40	486,780,000
コスモエネルギーHLDGS	135,000	1,883.00	254,205,000
ブリヂストン	65,000	4,772.00	310,180,000
旭硝子	280,000	939.00	262,920,000
太平洋セメント	950,000	380.00	361,000,000
ノザワ	165,000	1,169.00	192,885,000
日本碍子	65,000	2,445.00	158,925,000
日本特殊陶業	10,000	2,565.00	25,650,000
品川リフラクトリーズ	350,000	315.00	110,250,000
黒崎播磨	300,000	455.00	136,500,000
フジインコーポレーテッド	60,000	2,212.00	132,720,000
ニチアス	170,000	1,292.00	219,640,000
J F Eホールディングス	50,000	1,898.50	94,925,000
山陽特殊製鋼	240,000	612.00	146,880,000
日立金属	150,000	1,612.00	241,800,000
新日本電工	425,000	354.00	150,450,000
日本軽金属HD	1,350,000	248.00	334,800,000
三井金属	1,000,000	374.00	374,000,000
東邦亜鉛	550,000	491.00	270,050,000
三菱マテリアル	40,000	3,350.00	134,000,000
住友鉱山	315,000	1,478.50	465,727,500
D O W Aホールディングス	100,000	820.00	82,000,000
古河機金	675,000	217.00	146,475,000
U A C J	600,000	309.00	185,400,000
古河電工	40,000	4,690.00	187,600,000
住友電工	150,000	1,889.50	283,425,000
東京製綱	85,000	1,741.00	147,985,000
テクノプロ・ホールディング	50,000	4,350.00	217,500,000
東芝機械	250,000	492.00	123,000,000
D M G森精機	140,000	1,925.00	269,500,000
日進工具	45,000	1,672.00	75,240,000
三井海洋開発	80,000	2,585.00	206,800,000
三精テクノロジーズ	75,000	1,007.00	75,525,000
荏原製作所	25,000	3,430.00	85,750,000
北越工業	100,000	951.00	95,100,000
加藤製作所	20,000	2,932.00	58,640,000

タダノ	60,000	1,390.00	83,400,000
キトー	160,000	1,204.00	192,640,000
ツバキ・ナカシマ	105,000	2,059.00	216,195,000
日本精工	225,000	1,557.00	350,325,000
日本ピラ - 工業	115,000	1,579.00	181,585,000
三菱電機	150,000	1,647.00	247,050,000
愛知電機	45,000	2,728.00	122,760,000
ホーチキ	67,500	1,602.00	108,135,000
日立国際電気	50,000	2,491.00	124,550,000
デンソー	60,000	4,946.00	296,760,000
レーザーテック	100,000	1,400.00	140,000,000
カシオ	25,000	1,638.00	40,950,000
村田製作所	19,500	16,320.00	318,240,000
ニチユ三菱フォークリフト	100,000	642.00	64,200,000
日産自動車	490,000	1,075.00	526,750,000
いすゞ自動車	80,000	1,548.50	123,880,000
トヨタ自動車	130,000	6,081.00	790,530,000
三菱自動車工業	800,000	773.00	618,400,000
本田技研	220,000	3,230.00	710,600,000
S U B A R U	57,500	3,982.00	228,965,000
萩原電気	45,000	2,339.00	105,255,000
東京精密	30,000	3,630.00	108,900,000
キヤノン	60,000	3,846.00	230,760,000
バンダイナムコHLDGS	45,000	3,610.00	162,450,000
桑山	60,000	743.00	44,580,000
天馬	72,500	2,201.00	159,572,500
任天堂	8,000	29,500.00	236,000,000
伊藤忠	490,000	1,674.50	820,505,000
丸紅	300,000	723.70	217,110,000
三井物産	350,000	1,569.50	549,325,000
日立ハイテクノロジーズ	45,000	4,570.00	205,650,000
住友商事	290,000	1,554.00	450,660,000
三菱商事	340,000	2,364.00	803,760,000
伊藤忠エネクス	150,000	955.00	143,250,000
あおぞら銀行	1,250,000	421.00	526,250,000
三菱UFJフィナンシャルG	2,000,000	727.70	1,455,400,000
りそなホールディングス	550,000	610.10	335,555,000
三井住友トラストHD	50,000	4,005.00	200,250,000
三井住友フィナンシャルG	250,000	4,204.00	1,051,000,000
セブン銀行	400,000	383.00	153,200,000

みずほフィナンシャルG	1,750,000	208.90	365,575,000	
日立キャピタル	37,500	2,745.00	102,937,500	
オリックス	225,000	1,763.50	396,787,500	
三菱UFJリース	375,000	603.00	226,125,000	
野村ホールディングス	650,000	697.60	453,440,000	
SOMPOホールディングス	90,000	4,470.00	402,300,000	
MS&AD	132,500	3,730.00	494,225,000	
第一生命HLDGS	205,000	1,978.50	405,592,500	
東京海上HD	100,000	4,943.00	494,300,000	
T&Dホールディングス	295,000	1,732.50	511,087,500	
住友不動産	110,000	3,165.00	348,150,000	
トーセイ	100,000	816.00	81,600,000	
サンフロンティア不動産	120,000	1,116.00	133,920,000	
西日本旅客鉄道	10,000	7,560.00	75,600,000	
NSユナイテッド海運	350,000	245.00	85,750,000	
日本航空	95,000	3,419.00	324,805,000	
日本電信電話	170,000	5,050.00	858,500,000	
NTTドコモ	190,000	2,730.00	518,700,000	
電源開発	30,000	2,776.00	83,280,000	
日鉄住金物産	30,000	4,770.00	143,100,000	
パーカーコーポレーション	390,000	560.00	218,400,000	
東テク	120,000	1,793.00	215,160,000	
ソフトバンクグループ	55,000	8,700.00	478,500,000	
合計			33,565,794,500	

## (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	50	17,150,000	
	大和ハウスリート投資法人	100	28,760,000	
投資証券 合計			45,910,000	
合計			45,910,000	

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。



## 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28年11月11日から平成29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【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】

（単位：円）

	前 期 平成28年11月10日現在	当 期 平成29年5月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	15,443,150	12,458,362
親投資信託受益証券	1,065,880,037	1,038,536,104
流動資産合計	1,081,323,187	1,050,994,466
資産合計	1,081,323,187	1,050,994,466
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	3,388,562	1,839,414
未払受託者報酬	94,694	93,017
未払委託者報酬	2,320,596	2,279,417
その他未払費用	45,608	43,266
流動負債合計	5,849,460	4,255,114
負債合計	5,849,460	4,255,114
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 1,355,425,117	1 1,226,276,494
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 279,951,390	2 179,537,142
（分配準備積立金）	4,141,627	8,942,877
元本等合計	1,075,473,727	1,046,739,352
純資産合計	1,075,473,727	1,046,739,352
負債純資産合計	1,081,323,187	1,050,994,466

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 平成28年5月11日 至 平成28年11月10日		自 平成28年11月11日 至 平成29年5月10日	
営業収益				
有価証券売買等損益		43,259,545		92,656,067
営業収益合計		43,259,545		92,656,067
営業費用				
支払利息		2,674		2,910
受託者報酬		304,643		288,766
委託者報酬		1 7,465,110		1 7,076,114
その他費用		45,609		43,266
営業費用合計		7,818,036		7,411,056
営業利益又は営業損失（ ）		51,077,581		85,245,011
経常利益又は経常損失（ ）		51,077,581		85,245,011
当期純利益又は当期純損失（ ）		51,077,581		85,245,011
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		510,039		519,350
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		229,120,367		279,951,390
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,910,652		22,413,882
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,910,652		22,413,882
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,849,768		1,018,834
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,849,768		1,018,834
分配金		2 10,304,287		2 5,706,461
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		279,951,390		179,537,142

## (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28年11月11日 至 平成29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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1. 1 期首元本額	1,411,885,690円	1,355,425,117円
期中追加設定元本額	10,094,094円	6,086,004円
期中一部解約元本額	66,554,667円	135,234,627円
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,355,425,117口	1,226,276,494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279,951,390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179,537,142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28年5月11日 至 平成28年11月10日	自 平成28年11月11日 至 平成29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	310,815円	298,809円



## 2. 2 分配金の計算過程

(自平成28年5月11日 至平成28年7月11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(2,845,773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(463,555円)及び分配準備積立金(5,104,063円)より分配対象額は8,413,391円(1万口当たり60.31円)であり、うち3,487,625円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年7月12日 至平成28年9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(4,161,396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(473,567円)及び分配準備積立金(4,370,458円)より分配対象額は9,005,421円(1万口当たり65.67円)であり、うち3,428,100円(1万口当たり25円)を分配金額としております。

(自平成28年11月11日 至平成29年1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(4,445,070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(471,920円)及び分配準備積立金(4,047,396円)より分配対象額は8,964,386円(1万口当たり67.59円)であり、うち1,989,300円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

(自平成29年1月11日 至平成29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(1,825,925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(460,815円)及び分配準備積立金(6,125,184円)より分配対象額は8,411,924円(1万口当たり67.20円)であり、うち1,877,747円(1万口当たり15円)を分配金額としております。

<p>（自平成28年9月13日 至平成28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（2,491,694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（476,051円）及び分配準備積立金（5,038,495円）より分配対象額は8,006,240円（1万口当たり59.07円）であり、うち3,388,562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29年3月11日 至平成29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（4,840,753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（461,645円）及び分配準備積立金（5,941,538円）より分配対象額は11,243,936円（1万口当たり91.69円）であり、うち1,839,414円（1万口当たり15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28年11月11日 至 平成29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	<p>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。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 平成29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28年11月10日現在	当 期 平成29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	3,861,667	18,118,434
合計	3,861,667	18,118,434

## (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28年11月10日現在	当 期 平成29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28年11月11日 至 平成29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28年11月10日現在	当 期 平成29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)	0.7935円 (7,935円)	0.8536円 (8,536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	449,444,050	730,256,692	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	24,508,322	51,722,362	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	39,499,978	103,359,592	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	14,365,197	33,953,579	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	21,582,556	35,246,472	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	16,452,567	34,512,549	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	20,672,094	49,484,858	
親投資信託受益証券 合計			1,038,536,104	
合計			1,038,536,104	

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」-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」-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28年11月11日から平成29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【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】

（単位：円）

	前 期 平成28年11月10日現在	当 期 平成29年5月10日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	76,547,122	75,164,515
親投資信託受益証券	5,075,789,615	5,244,915,422
未収入金	6,000,000	6,000,000
流動資産合計	5,158,336,737	5,326,079,937
資産合計	5,158,336,737	5,326,079,937
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	24,265,764	22,271,832
未払解約金	5,535,092	3,587,004
未払受託者報酬	449,093	467,271
未払委託者報酬	11,676,800	12,149,473
その他未払費用	215,154	213,847
流動負債合計	42,141,903	38,689,427
負債合計	42,141,903	38,689,427
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 6,066,441,064	1 5,567,958,166
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 950,246,230	2 280,567,656
（分配準備積立金）	273,518,937	248,932,042
元本等合計	5,116,194,834	5,287,390,510
純資産合計	5,116,194,834	5,287,390,510
負債純資産合計	5,158,336,737	5,326,079,937

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 平成28年5月11日 至 平成28年11月10日		自 平成28年11月11日 至 平成29年5月10日	
営業収益				
有価証券売買等損益		47,940,603		738,125,807
営業収益合計		47,940,603		738,125,807
営業費用				
支払利息		11,974		13,513
受託者報酬		1,434,955		1,425,050
委託者報酬		1 37,310,001		1 37,052,694
その他費用		215,161		213,847
営業費用合計		38,972,091		38,705,104
営業利益又は営業損失（ ）		86,912,694		699,420,703
経常利益又は経常損失（ ）		86,912,694		699,420,703
当期純利益又は当期純損失（ ）		86,912,694		699,420,703
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		2,645,711		13,632,798
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		837,684,322		950,246,230
剰余金増加額又は欠損金減少額		56,686,468		54,783,104
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		56,686,468		54,783,104
剰余金減少額又は欠損金増加額		5,619,002		2,473,175
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		5,619,002		2,473,175
分配金		2 74,070,969		2 68,419,260
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		950,246,230		280,567,656



## (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28年11月11日 至 平成29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28年11月10日現在	平成29年5月10日現在
1. 1 期首元本額	6,388,728,449円	6,066,441,064円
期中追加設定元本額	35,863,134円	29,786,290円
期中一部解約元本額	358,150,519円	528,269,188円
2. 特定期間末日における受益権の総数	6,066,441,064口	5,567,958,166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950,246,230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280,567,656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28年5月11日 至 平成28年11月10日	自 平成28年11月11日 至 平成29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	3,652,878円	3,686,859円

## 2. 2 分配金の計算過程

(自平成28年5月11日 至平成28年7月11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(16,840,463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(6,387,224円)及び分配準備積立金(301,797,890円)より分配対象額は325,025,577円(1万口当たり518.05円)であり、うち25,096,092円(1万口当たり40円)を分配金額としております。

(自平成28年7月12日 至平成28年9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(15,252,176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(6,981,273円)及び分配準備積立金(288,333,095円)より分配対象額は310,566,544円(1万口当たり502.76円)であり、うち24,709,113円(1万口当たり40円)を分配金額としております。

(自平成28年11月11日 至平成29年1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(17,031,064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(7,310,591円)及び分配準備積立金(263,712,750円)より分配対象額は288,054,405円(1万口当たり491.91円)であり、うち23,423,474円(1万口当たり40円)を分配金額としております。

(自平成29年1月11日 至平成29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(15,301,358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(7,392,329円)及び分配準備積立金(249,339,971円)より分配対象額は272,033,658円(1万口当たり478.85円)であり、うち22,723,954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28年9月13日 至平成28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(24,283,569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(7,242,591円)及び分配準備積立金(273,501,132円)より分配対象額は305,027,292円(1万口当たり502.81円)であり、うち24,265,764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29年3月11日 至平成29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(34,764,511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(7,954,758円)及び分配準備積立金(236,439,363円)より分配対象額は279,158,632円(1万口当たり501.37円)であり、うち22,271,832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28年11月11日 至 平成29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	<p>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。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 平成29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28年11月10日現在	当 期 平成29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	81,743,937	83,728,813
合計	81,743,937	83,728,813

## （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28年11月10日現在	当 期 平成29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28年11月11日 至 平成29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28年11月10日現在	当 期 平成29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)	0.8434円 (8,434円)	0.9496円 (9,496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	639,893,968	1,039,699,719	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	123,113,562	259,818,861	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	701,905,867	1,836,677,082	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	258,897,305	611,929,670	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	384,883,563	628,553,346	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株 マザーファンド	294,023,628	616,773,364	
	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	105,047,782	251,463,380	
親投資信託受益証券 合計			5,244,915,422	
合計			5,244,915,422	

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」-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」-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29年5月31日

資産総額	1,098,454,526円
負債総額	830,902円
純資産総額（ - ）	1,097,623,624円
発行済数量	1,215,491,984口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9030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29年5月31日

資産総額	32,843,735,171円
負債総額	41,395,547円
純資産総額（ - ）	32,802,339,624円
発行済数量	20,128,110,094口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.6297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29年5月31日

資産総額	359,159,930,356円
負債総額	210,825,665円
純資産総額（ - ）	358,949,104,691円
発行済数量	286,617,026,979口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2524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29年5月31日

資産総額	115,391,415,480円
負債総額	147,637,901円
純資産総額（ - ）	115,243,777,579円
発行済数量	55,178,304,808口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.0886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29年5月31日

資産総額	82,047,752,727円
負債総額	64,240,647円
純資産総額（ - ）	81,983,512,080円
発行済数量	34,706,444,999口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.3622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29年5月31日

資産総額	2,031,326,266円
負債総額	1,381,467円
純資産総額（ - ）	2,029,944,799円
発行済数量	877,048,258口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.3145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29年5月31日

資産総額	1,298,804,583円
負債総額	2,162,006円
純資産総額（ - ）	1,296,642,577円
発行済数量	798,674,830口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.6235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29年5月31日

資産総額	961,272,270円
負債総額	16,287,178円
純資産総額( - )	944,985,092円
発行済数量	458,453,561口
1単位当たり純資産額( / )	2.0612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29年5月31日

資産総額	33,964,764,582円
負債総額	35,555,836円
純資産総額( - )	33,929,208,746円
発行済数量	13,294,349,525口
1単位当たり純資産額( / )	2.5522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29年5月31日

資産総額	1,036,801,978円
負債総額	830,389円
純資産総額( - )	1,035,971,589円
発行済数量	1,218,141,412口
1単位当たり純資産額( / )	0.8505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29年5月31日

資産総額	5,136,161,455円
負債総額	10,642,041円
純資産総額（ - ）	5,125,519,414円
発行済数量	5,479,734,403口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9354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29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29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	74	205,390
追加型株式投資信託	688	13,488,992
株式投資信託 合計	762	13,694,382
単位型公社債投資信託	17	106,757
追加型公社債投資信託	14	2,117,421
公社債投資信託 合計	31	2,224,177
総合計	793	15,918,559

## 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28年4月1日から平成29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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,715	31,260
有価証券	1,137	110
前払費用	159	190
未収委託者報酬	9,896	10,453
未収収益	87	72
繰延税金資産	468	439
その他	83	34
流動資産計	43,547	42,560
固定資産		
有形固定資産	1	1
建物	243	229
器具備品	18	15
器具備品	224	214
無形固定資産	2,706	2,650
ソフトウェア	2,385	2,323
ソフトウェア仮勘定	321	327
投資その他の資産	14,223	12,353
投資有価証券	7,872	5,920
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	123	185

長期差入保証金	1,049	1,050
繰延税金資産	-	31
その他	47	37
固定資産計	17,173	15,234
資産合計	60,720	57,795

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	61	79
未払金	8,789	9,466
未払収益分配金	5	7
未払償還金	63	59
未払手数料	4,330	4,453
その他未払金	2	2
未払費用	4,215	4,077
未払法人税等	1,155	980
未払消費税等	538	223
賞与引当金	937	945
その他	22	3
流動負債計	15,720	15,776
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,209	2,318
役員退職慰労引当金	93	151
繰延税金負債	1,410	-
その他	-	7
固定負債計	3,714	2,477
負債合計	19,435	18,254
<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	13,960	12,231
利益剰余金合計	14,334	12,606
株主資本合計	41,004	39,276
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	280	264
評価・換算差額等合計	280	264
純資産合計	41,284	39,540
負債・純資産合計	60,720	57,795

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	88,850	79,747
その他営業収益	799	727
営業収益計	89,650	80,474
営業費用		
支払手数料	46,165	40,110
広告宣伝費	646	549
調査費	10,116	9,436
調査費	925	904
委託調査費	9,191	8,531
委託計算費	761	793
営業雑経費	1,346	1,375
通信費	249	251
印刷費	515	501
協会費	53	50
諸会費	14	13
その他営業雑経費	513	557
営業費用計	59,036	52,265
一般管理費		
給料	5,797	5,833
役員報酬	354	416
給料・手当	3,850	3,940
賞与	654	531



賞与引当金繰入額	937	945
福利厚生費	837	807
交際費	70	60
旅費交通費	211	178
租税公課	325	531
不動産賃借料	1,258	1,273
退職給付費用	394	463
役員退職慰労引当金繰入額	37	60
固定資産減価償却費	1,110	1,045
諸経費	1,486	1,400
一般管理費計	11,531	11,655
営業利益	19,082	16,554

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	109	92
受取利息	25	12
投資有価証券売却益	115	224
有価証券償還益	0	94
外国税関連費用引当金戻入益	171	-
その他	72	56
営業外収益計	496	481
営業外費用		
投資有価証券売却損	14	24
その他	94	75
営業外費用計	108	100
経常利益	19,471	16,935
特別損失		
MMF等償還関連費用	-	305
特別損失計	-	305
税引前当期純利益	19,471	16,629
法人税、住民税及び事業税	6,215	6,501
法人税等調整額	6	1,405
法人税等合計	6,209	5,096
当期純利益	13,262	11,533

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	13,960	14,334	41,004
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	13,261	13,261	13,261
当期純利益	-	-	-	11,533	11,533	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,728	1,728	1,728
当期末残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	280	280	41,284
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	13,261
当期純利益	-	-	11,533
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	15	15	15
当期変動額合計	15	15	1,743
当期末残高	264	264	39,540

## 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「有価証券償還益」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73百万円は、「有価証券償還益」0百万円、「その他」72百万円として組替えております。

### (追加情報)

「繰延税金資産の回収可能性に関する摘要指針(企業会計基準適用指針第26号 平成28年3月28日)」を当期から適用しております。

(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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
建物	23百万円	26百万円
器具備品	232百万円	264百万円

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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
未払金	4,320百万円	4,877百万円

3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(平成29年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,685百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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28年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成28年 3月31日	平成28年 6月24日

## (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29年6月26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	11,532百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,421円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月27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。

当事業年度（平成29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	31,260	31,260	-
(2) 未収委託者報酬	10,453	10,453	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	5,060	5,060	-
資産計	46,774	46,774	-
(1) 未払手数料	4,453	4,453	-
(2) その他未払金	4,946	4,946	-
(3) 未払費用(*)	3,409	3,409	-
負債計	12,809	12,809	-

(\*) 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28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	1,021	970
(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	1,049	1,050

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 其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

当事業年度（平成29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	31,260	-	-	-
未収委託者報酬	10,453	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 其他有価証券のうち満期があるもの	110	2,876	1,139	110
合計	41,824	2,876	1,139	110

## （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。

当事業年度（平成29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．其他有価証券

前事業年度（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。

当事業年度(平成29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	122	55	67
(2) その他			
証券投資信託	3,107	2,697	410
小計	3,230	2,752	478
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	1,829	1,926	96
小計	1,829	1,926	96
合計	5,060	4,679	381

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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	50	-	1
(2) その他			
証券投資信託	4,371	224	23
合計	4,421	224	24

## 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、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。

当事業年度において、該当事項はありません。

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,072百万円	2,209百万円
勤務費用	222	202
退職給付の支払額	120	122
その他	35	29
退職給付債務の期末残高	2,209	2,318

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

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,209百万円	2,318百万円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,209	2,318
退職給付引当金	2,209	2,318
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	2,209	2,318

## (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27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	当事業年度 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)
勤務費用	222百万円	202百万円
その他	-	87
確定給付制度に係る退職給付費用	222	289

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度172百万円、当事業年度173百万円であります。

## (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28年 3月31日)	当事業年度 (平成29年 3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金	676	709
賞与引当金	225	224
未払事業税	224	169
連結法人間取引(譲渡損)	121	5
出資金評価損	98	98
投資有価証券評価損	95	65
その他	173	185
繰延税金資産小計	1,615	1,458
評価性引当額	347	201
繰延税金資産合計	1,268	1,257
繰延税金負債		
連結法人間取引(譲渡益)	2,086	639
その他有価証券評価差額金	124	146
繰延税金負債合計	2,210	786
繰延税金資産の純額	941	470

## 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28年 3月31日)	当事業年度 (平成29年 3月31日)
--	------------------------	------------------------

法定実効税率 (調整)	33.06%	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.77%	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.02%	
評価性引当額の増減額	1.29%	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.19%	
その他	0.43%	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.89%	

(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、記載を省略していません。

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、記載を省略していません。

(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、記載を省略していません。

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。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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。

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29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)	1,685	-	-

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。

## 当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29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)	23,238	未払手数料	3,298
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)	768	未払費用	218
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)	1,036	長期差入保証金	1,028

## 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27年4月1日 至 平成28年3月31日)		当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,826.85円	1株当たり純資産額	15,158.25円
1株当たり当期純利益	5,084.10円	1株当たり当期純利益	4,421.51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27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
当期純利益(百万円)	13,262	11,533
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

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

## 第2 【その他の関係法人の概況】

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

< 訂正後 >

## 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（平成29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29年3月 末日現在）	事業の内容
株式会社SBI証券	48,323	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	21,425	
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	62,275	（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)	2,016,185

(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 504千米ドル(約58百万円)(平成28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127百万円)(平成28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41,500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29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。

### 第3 【その他】

<更新後>

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

<略>

委託会社のインターネットホームページのアドレスに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含まれます。）を掲載することがあります。

<略>

## 独立監査人の監査報告書

平成29年6月16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28年11月11日から平成29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29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29年6月16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28年11月11日から平成29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29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29年6月16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28年11月11日から平成29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29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29年 5月26日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

### 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の財務諸表、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29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。