

【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30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】 高橋 慎
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】 03-5555-3431

【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】 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】

2018年2月2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>

◆欧州の株式の運用は、アムンディ・アイルランド・リミテッドが行ないます。

ダイワ欧州好配当株マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランド・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。

<アムンディ・アイルランド・リミテッドについて>

アムンディ・アイルランド・リミテッドは、運用資産額で欧州および世界でトップクラスに入るフランスの資産運用会社アムンディ・グループの主要運用拠点のひとつで、アイルランド（ダブリン市）に所在します。

<略>

(3) 【ファンドの仕組み】

<更新後>

<略>

投資対象

内外の公社債、不動産投資信託証券および株式 などファミリーファンド方式で運用を行ないます。
 なお、次の各マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社（注2）に運用の指図にかかる権限を委託します（カッコ内は投資顧問会社名）。
 ・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド（コーヘン&ステイアーズ・キャピタル・マネジメント・インク）
 ・ダイワ北米好配当株マザーファンド（コーヘン&ステイアーズ・キャピタル・マネジメント・インク）
 ・ダイワ欧州好配当株マザーファンド（アムンディ・アイルランド・リミテッド）

<略>

<委託会社の概況（2018年5月末日現在）>

<略>

2 【投資方針】

(3) 運用体制

<更新後>

<略>

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

次のとおり各会議体において必要な報告・審議等を行なっています。これら会議体の事務局となる内部管理関連部門の人員は25～35名程度です。

<略>

上記の運用体制は2018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。

<参考> マザーファンドの概要

<更新後>

<略>

5. ダイワ北米好配当株マザーファンド

6. ダイワ欧州好配当株マザーファンド

7. ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド

(1) 【投資方針】

<略>

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

<略>

投資態度

<略>

八．外貨建資産の運用にあたっては、アムンディ・アイルランド・リミテッドに運用の指図にかかる権限を委託します。

<略>

(4) 運用指図権限の委託

<略>

<ダイワ欧州好配当株マザーファンド>

委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次の者に委託します。

アムンディ・アイルランド・リミテッド

<略>

3 【投資リスク】

<更新後>

<略>

参考情報

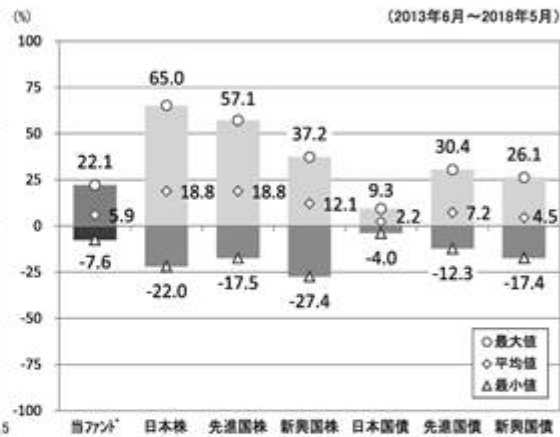
- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間における年間騰落率（各月末における直近1年間の騰落率）の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示しています。また左のグラフはファンドの過去5年間における年間騰落率の推移を表示しています。

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移

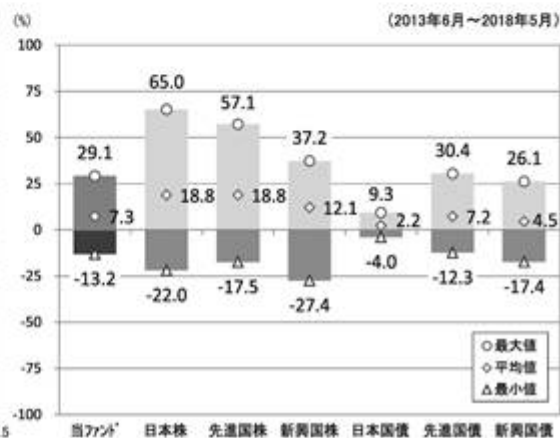
[安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）]



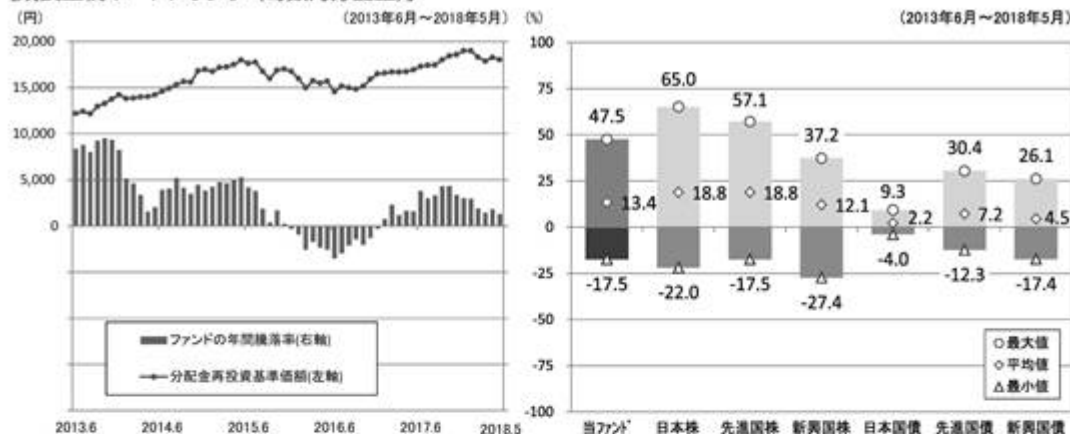
他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



[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：FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ベース）
 新興国債：JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイド（円ベース）

※指数について

●TOPIXは東証が算出・公表し、指数値、商標など一切の権利は株式会社東京証券取引所が所有しています。●MSCIコクサイ・インデックスおよびMSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村証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証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。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(3) 【信託報酬等】

<更新後>

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に次に掲げる率を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

<略>

(5) 【課税上の取扱い】

<更新後>

<略>

（ ）上記は、2018年5月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

< 略 >

5 【運用状況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第1 ファンドの状況 5 運用状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

【安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【投資状況】（平成30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	945,876,454	98.95
内 日本	945,876,454	98.95
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	10,053,184	1.05
純資産総額	955,929,638	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30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	ダイワ日本国債マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	267,649,991	1.2550 335,900,739	1.2563 336,248,683	35.18
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	202,718,806	1.6500 334,493,410	1.6291 330,249,206	34.55
3	ダイワ好配当日本株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	30,994,754	3.0430 94,317,037	2.9902 92,680,513	9.70
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	21,841,248	2.2182 48,448,256	2.2028 48,111,901	5.03
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	19,092,673	2.4512 46,801,869	2.4575 46,920,243	4.91
6	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	12,357,113	2.4996 30,889,075	2.5004 30,897,725	3.23
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	13,647,901	2.2682 30,956,169	2.2473 30,670,927	3.21
8	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	18,843,762	1.6822 31,698,976	1.5972 30,097,256	3.15

(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	98.95%

合計	98.95%
----	--------

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

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
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
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
平成29年5月末日	1,097,623,624	-	0.9030	-
6月末日	1,091,238,587	-	0.9122	-
7月末日	1,058,791,939	-	0.9139	-
8月末日	1,061,240,568	-	0.9180	-
9月末日	1,052,890,516	-	0.9263	-
10月末日	1,035,483,716	-	0.9309	-
第24特定期間末 (平成29年11月10日)	1,034,788,125	1,036,447,975	0.9351	0.9366
11月末日	1,029,645,163	-	0.9337	-
12月末日	1,031,085,756	-	0.9437	-
平成30年1月末日	1,015,699,084	-	0.9346	-
2月末日	979,026,914	-	0.9139	-
3月末日	971,806,700	-	0.9072	-
4月末日	976,597,264	-	0.9160	-
第25特定期間末 (平成30年5月10日)	967,647,840	969,234,113	0.9150	0.9165
5月末日	955,929,638	-	0.9071	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第24特定期間	0.0045

第25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
第24特定期間	3.6
第25特定期間	1.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第24特定期間	50,120,711	181,487,643
第25特定期間	19,575,536	68,626,578

(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30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		28,543,448,583	94.55
	内 ユーロ	7,097,464,480	23.51
	内 ノルウェー	707,980,108	2.35
	内 スウェーデン	578,408,635	1.92
	内 デンマーク	811,617,698	2.69
	内 イギリス	3,349,537,165	11.10
	内 ポーランド	2,081,918,534	6.90
	内 カナダ	2,844,330,080	9.42
	内 アメリカ	7,315,580,547	24.23
	内 オーストラリア	3,756,611,336	12.44
特殊債券		957,488,060	3.17
	内 カナダ	957,488,060	3.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		686,698,323	2.27
純資産総額		30,187,634,966	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)		4,695,353,620	15.55
	内 日本	4,695,353,620	15.55
為替予約取引(売建)		4,710,011,747	15.60
	内 日本	4,710,011,747	15.60

(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30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	45,000,000	92.03 4,502,087,685	91.69 4,485,260,925	1.625000 2026/02/15	14.86
2	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	24,000,000	119.56 2,363,122,188	120.12 2,374,190,028	4.500000 2033/04/21	7.86
3	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	15,000,000	107.96 2,052,265,620	104.81 1,992,480,742	1.950000 2026/04/30	6.60

4	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	9,300,000	125.01 1,680,711,661	125.96 1,693,470,093	5.000000 2025/03/07	5.61
5	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	19,000,000	100.94 1,617,795,042	100.33 1,608,066,957	2.250000 2025/06/01	5.33
6	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	39,000,000	113.57 1,301,750,697	112.24 1,286,563,414	5.750000 2021/10/25	4.26
7	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	10,000,000	101.61 1,287,754,222	98.35 1,246,465,588	1.400000 2028/04/30	4.13
8	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	13,500,000	95.33 1,085,614,866	94.75 1,079,010,261	1.500000 2026/06/01	3.57
9	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	8,000,000	103.02 1,044,508,660	102.27 1,036,925,136	1.000000 2026/05/15	3.43
10	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	5,900,000	133.92 1,001,389,030	132.57 991,242,646	5.400000 2025/03/13	3.28
11	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,200,000	139.05 916,393,247	137.36 905,210,085	3.250000 2045/05/25	3.00
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	96.61 840,181,432	96.23 836,850,864	2.250000 2025/11/15	2.77
13	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	27,000,000	100.89 800,592,417	100.23 795,355,119	2.250000 2022/04/25	2.63
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,200,000	96.89 758,299,896	96.74 757,141,588	1.375000 2021/04/30	2.51
15	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	8,000,000	110.76 729,746,172	110.42 727,479,900	5.750000 2021/05/15	2.41
16	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,400,000	90.20 725,574,891	90.39 727,079,082	2.500000 2046/02/15	2.41
17	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	4,500,000	101.21 658,449,838	102.64 667,726,254	1.500000 2026/07/22	2.21
18	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	6,800,000	116.85 654,336,630	116.95 654,941,408	4.750000 2027/04/21	2.17
19	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	34,000,000	111.25 644,171,330	112.35 650,557,921	1.750000 2025/11/15	2.16
20	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	7,000,000	98.25 580,146,647	97.80 577,495,527	2.250000 2025/12/15	1.91
21	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,500,000	101.62 514,191,969	102.23 517,288,444	1.500000 2021/01/22	1.71
22	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	36,000,000	107.89 478,915,448	108.75 482,728,377	1.500000 2023/11/13	1.60
23	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,800,000	108.01 383,277,649	108.81 386,116,401	1.500000 2023/02/15	1.28
24	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	4,500,000	100.53 381,590,543	100.11 379,992,532	2.550000 2025/03/15	1.26
25	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	25,500,000	107.91 364,906,514	107.87 364,757,737	3.750000 2021/05/25	1.21
26	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	108.18 286,893,360	108.76 288,447,432	3.000000 2024/03/14	0.96
27	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,500,000	150.22 285,577,817	147.18 279,789,424	3.750000 2045/06/22	0.93
28	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,500,000	98.85 268,638,462	98.83 268,575,960	1.500000 2019/10/31	0.89

29	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	1,500,000	133.17 253,162,818	136.37 259,234,452	2.500000 2046/08/15	0.86
30	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,500,000	111.66 242,125,712	112.21 243,327,006	4.000000 2022/03/07	0.81

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	94.55%
特殊債券	3.17%
合計	97.73%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

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	豪ドル買/円売 2018年6月	買建	13,800,000	1,138,176,860	1,136,292,000	3.76%
		カナダ・ドル買/円売 2018年6月	買建	27,479,608	2,336,663,000	2,316,954,634	7.68%
		ユーロ買/円売 2018年6月	買建	3,200,000	405,955,196	405,536,000	1.34%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2018年6月	買建	67,848,417	851,736,000	836,570,986	2.77%
		豪ドル売/円買 2018年6月	売建	28,300,000	2,336,663,000	2,329,256,000	7.72%
		カナダ・ドル売/円買 2018年6月	売建	13,512,725	1,138,176,860	1,139,663,260	3.78%
		ユーロ売/円買 2018年6月	売建	6,600,000	851,736,000	836,450,000	2.77%
		スウェーデン・クローネ 売/円買 2018年6月	売建	32,817,720	405,955,196	404,642,487	1.34%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワ日本国債マザーファンド

(1) 投資状況 (平成30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		282,043,046,510	99.33
内	日本	282,043,046,510	99.33

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,907,645,957	0.67
純資産総額	283,950,692,467	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30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	4 30年国債	日本	国債証券	13,900,000,000	134.32 18,670,828,000	133.91 18,613,768,000	2.900000 2030/11/20	6.56
2	142 20年国債	日本	国債証券	15,200,000,000	121.77 18,510,104,000	122.19 18,573,488,000	1.800000 2032/12/20	6.54
3	1 30年国債	日本	国債証券	13,250,000,000	130.75 17,324,507,500	130.39 17,277,735,000	2.800000 2029/09/20	6.08
4	48 20年国債	日本	国債証券	15,901,000,000	107.34 17,068,630,630	106.75 16,975,589,580	2.500000 2020/12/21	5.98
5	43 20年国債	日本	国債証券	13,872,000,000	104.64 14,516,770,560	103.97 14,423,828,160	2.900000 2019/09/20	5.08
6	6 30年国債	日本	国債証券	11,050,000,000	129.39 14,298,099,000	129.36 14,295,164,000	2.400000 2031/11/20	5.03
7	54 20年国債	日本	国債証券	12,387,000,000	108.80 13,477,799,220	108.31 13,417,226,790	2.200000 2021/12/20	4.73
8	70 20年国債	日本	国債証券	10,838,000,000	115.55 12,523,605,380	115.08 12,472,587,160	2.400000 2024/06/20	4.39
9	56 20年国債	日本	国債証券	10,420,000,000	109.08 11,367,075,000	108.65 11,321,746,800	2.000000 2022/06/20	3.99
10	101 20年国債	日本	国債証券	8,160,000,000	123.54 10,081,190,400	123.15 10,049,611,200	2.400000 2028/03/20	3.54
11	42 20年国債	日本	国債証券	9,548,000,000	102.78 9,814,229,320	102.19 9,757,865,040	2.600000 2019/03/20	3.44
12	102 20年国債	日本	国債証券	7,800,000,000	124.15 9,683,856,000	123.62 9,642,906,000	2.400000 2028/06/20	3.40
13	106 20年国債	日本	国債証券	7,480,000,000	122.30 9,148,456,000	121.97 9,123,879,600	2.200000 2028/09/20	3.21
14	40 20年国債	日本	国債証券	9,002,000,000	101.28 9,117,312,350	100.74 9,068,884,860	2.300000 2018/09/20	3.19
15	95 20年国債	日本	国債証券	7,405,000,000	121.14 8,970,417,000	120.71 8,938,575,500	2.300000 2027/06/20	3.15
16	86 20年国債	日本	国債証券	6,700,000,000	118.67 7,951,225,000	118.30 7,926,703,000	2.300000 2026/03/20	2.79
17	68 20年国債	日本	国債証券	6,325,000,000	113.74 7,194,624,250	113.31 7,167,363,500	2.200000 2024/03/20	2.52
18	91 20年国債	日本	国債証券	6,000,000,000	119.64 7,178,880,000	119.29 7,157,820,000	2.300000 2026/09/20	2.52
19	75 20年国債	日本	国債証券	5,474,000,000	115.21 6,307,018,400	114.78 6,283,440,380	2.100000 2025/03/20	2.21

20	65	20年国債	日本	国債証券	4,500,000,000	111.47 5,016,465,000	111.10 4,999,770,000	1.900000 2023/12/20	1.76
21	64	20年国債	日本	国債証券	4,500,000,000	111.07 4,998,175,000	110.66 4,979,880,000	1.900000 2023/09/20	1.75
22	80	20年国債	日本	国債証券	4,173,000,000	115.68 4,827,493,320	115.25 4,809,632,880	2.100000 2025/06/20	1.69
23	88	20年国債	日本	国債証券	3,760,000,000	119.16 4,480,604,000	118.80 4,467,105,600	2.300000 2026/06/20	1.57
24	44	20年国債	日本	国債証券	4,245,000,000	105.35 4,472,107,500	104.76 4,447,231,800	2.500000 2020/03/20	1.57
25	7	30年国債	日本	国債証券	3,350,000,000	128.69 4,311,115,000	128.62 4,308,803,500	2.300000 2032/05/20	1.52
26	94	20年国債	日本	国債証券	3,300,000,000	118.96 3,925,713,000	118.48 3,909,840,000	2.100000 2027/03/20	1.38
27	83	20年国債	日本	国債証券	3,300,000,000	116.58 3,847,140,000	116.25 3,836,481,000	2.100000 2025/12/20	1.35
28	58	20年国債	日本	国債証券	3,325,000,000	109.18 3,630,268,250	108.73 3,615,571,750	1.900000 2022/09/20	1.27
29	52	20年国債	日本	国債証券	3,268,000,000	107.91 3,526,564,160	107.44 3,511,171,880	2.100000 2021/09/21	1.24
30	92	20年国債	日本	国債証券	2,970,000,000	118.53 3,520,341,000	118.06 3,506,471,100	2.100000 2026/12/20	1.23

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	99.33%
合計	99.33%

(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30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	97,995,384,091	96.66
内 香港	2,645,155,878	2.61

内 シンガポール	4,715,323,023	4.65
内 イギリス	11,325,851,539	11.17
内 ベルギー	628,712,409	0.62
内 フランス	7,849,924,559	7.74
内 ドイツ	1,164,971,458	1.15
内 スペイン	3,018,777,713	2.98
内 イタリア	117,098,884	0.12
内 カナダ	2,742,478,626	2.71
内 アメリカ	48,343,809,934	47.69
内 オーストラリア	15,443,280,068	15.23
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,383,215,570	3.34
純資産総額	101,378,599,661	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)	117,687,638	0.12
内 日本	117,687,638	0.12
為替予約取引(売建)	118,119,127	0.12
内 日本	118,119,127	0.12

(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30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	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	4,299,800	693.38 2,981,425,423	765.85 3,293,023,329	3.25
2	DEXUS	オーストラリア	投資証券	3,914,079	774.91 3,033,072,657	814.44 3,187,788,372	3.14
3	GECINA SA	フランス	投資証券	155,846	17,852.58 2,782,258,655	18,059.02 2,814,426,810	2.78
4	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	229,084	11,464.58 2,626,353,906	11,741.77 2,689,852,555	2.65
5	FONCIERE DES REGIONS	フランス	投資証券	237,822	11,380.73 2,706,592,782	11,171.24 2,656,768,899	2.62
6	LINK REIT	香港	投資証券	2,769,920	948.72 2,627,892,352	954.95 2,645,155,878	2.61
7	UDR INC	アメリカ	投資証券	650,299	3,863.19 2,512,233,796	3,961.02 2,575,852,547	2.54
8	GPT GROUP	オーストラリア	投資証券	6,058,482	383.75 2,324,948,526	414.22 2,509,547,443	2.48

9	CROWN CASTLE INTL CORP	アメリカ	投資証券	212,881	12,115.59 2,579,184,286	11,306.97 2,407,039,932	2.37
10	KLEPIERRE	フランス	投資証券	562,989	4,244.18 2,389,432,104	4,225.17 2,378,728,850	2.35
11	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	2,425,985	877.62 2,129,113,287	938.77 2,277,448,343	2.25
12	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	170,119	13,577.39 2,309,776,638	13,275.53 2,258,420,058	2.23
13	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	193,758	9,718.86 1,883,108,232	10,512.37 2,036,857,143	2.01
14	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	102,893	17,227.86 1,772,626,508	17,564.83 1,807,298,362	1.78
15	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	スペイン	投資証券	1,201,160	1,504.91 1,807,729,885	1,495.41 1,796,231,480	1.77
16	KILROY REALTY CORP	アメリカ	投資証券	215,010	7,667.69 1,648,631,747	8,293.81 1,783,252,088	1.76
17	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	67,477	25,943.42 1,750,584,759	26,229.31 1,769,875,151	1.75
18	FORTUNE REIT	シンガポール	投資証券	13,505,070	129.49 1,748,872,802	129.77 1,752,613,707	1.73
19	NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア	投資証券	13,294,696	126.81 1,686,020,052	131.34 1,746,235,054	1.72
20	KEPPEL DC REIT	シンガポール	投資証券	15,003,913	112.70 1,691,165,970	112.05 1,681,278,475	1.66
21	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	238,220	6,934.95 1,652,051,708	7,043.76 1,677,964,507	1.66
22	INVESTA OFFICE FUND	オーストラリア	投資証券	3,950,536	354.92 1,402,157,817	417.51 1,649,406,063	1.63
23	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	7,421,624	223.16 1,656,272,696	220.69 1,637,937,574	1.62
24	PHYSICIANS REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	978,661	1,641.37 1,606,344,806	1,665.28 1,629,748,505	1.61
25	ASSURA PLC	イギリス	投資証券	18,662,035	89.33 1,669,398,709	82.11 1,532,341,187	1.51
26	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	145,085	9,365.59 1,358,806,915	10,537.37 1,528,815,487	1.51
27	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	カナダ	投資証券	403,368	3,483.65 1,405,194,950	3,627.05 1,463,035,904	1.44
28	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	2,709,982	482.57 1,307,758,724	523.74 1,419,342,233	1.40
29	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	547,186	2,056.60 1,125,344,916	2,371.83 1,297,834,359	1.28
30	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	カナダ	投資証券	317,793	3,767.07 1,197,148,794	4,026.02 1,279,442,722	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。

□ . 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	96.66%
合計	96.66%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2018年6月	買建	1,082,783	118,133,473	117,687,638	0.12%
		豪ドル売/円買 2018年6月	売建	1,434,529	118,133,473	118,119,127	0.12%

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンド

(1) 投資状況（平成30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	99,245,405,160	98.46
内 日本	99,245,405,160	98.46
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,556,582,909	1.54
純資産総額	100,801,988,069	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30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	15,689	568,093.05 8,912,811,937	571,000.00 8,958,419,000	8.89
2	野村不動産マスターF	日本	投資証券	39,468	154,500.00 6,097,806,000	152,400.00 6,014,923,200	5.97
3	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	19,420	262,012.80 5,088,288,590	256,600.00 4,983,172,000	4.94
4	日本ビルファンド	日本	投資証券	7,793	622,000.00 4,847,246,000	610,000.00 4,753,730,000	4.72

5	日本プロロジスリート	日本	投資証券	20,899	231,100.00 4,829,758,900	227,000.00 4,744,073,000	4.71
6	日本リテールファンド	日本	投資証券	19,010	204,296.61 3,883,678,619	197,400.00 3,752,574,000	3.72
7	オリックス不動産投資	日本	投資証券	21,199	171,600.00 3,637,748,400	171,900.00 3,644,108,100	3.62
8	API投資法人	日本	投資証券	6,914	485,500.00 3,356,747,000	484,500.00 3,349,833,000	3.32
9	森ヒルズリート	日本	投資証券	21,092	140,100.00 2,954,989,200	140,000.00 2,952,880,000	2.93
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	16,960	172,600.00 2,927,296,000	166,800.00 2,828,928,000	2.81
11	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	7,129	404,000.00 2,880,116,000	395,500.00 2,819,519,500	2.80
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	33,676	81,300.00 2,737,858,800	81,200.00 2,734,491,200	2.71
13	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	8,480	283,000.00 2,399,840,000	284,900.00 2,415,952,000	2.40
14	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	5,337	452,500.00 2,414,992,500	449,000.00 2,396,313,000	2.38
15	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	3,446	669,000.00 2,305,374,000	675,000.00 2,326,050,000	2.31
16	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	31,843.1	69,500.00 2,213,095,450	71,400.00 2,273,597,340	2.26
17	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	13,254	166,964.55 2,212,948,169	171,100.00 2,267,759,400	2.25
18	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	42,818	50,015.86 2,141,579,308	50,000.00 2,140,900,000	2.12
19	日本リート投資法人	日本	投資証券	5,982	332,000.00 1,986,024,000	331,000.00 1,980,042,000	1.96
20	GLP投資法人	日本	投資証券	14,491	118,300.00 1,714,285,300	121,600.00 1,762,105,600	1.75
21	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	7,264	230,500.00 1,674,352,000	242,100.00 1,758,614,400	1.74
22	MCUBS MidCity投資法人	日本	投資証券	20,805	83,000.00 1,726,815,000	84,200.00 1,751,781,000	1.74
23	イオンリート投資	日本	投資証券	13,519	116,700.00 1,577,667,300	123,000.00 1,662,837,000	1.65
24	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,580	631,000.00 1,627,980,000	637,000.00 1,643,460,000	1.63
25	インベスコ・オフィス・リート	日本	投資証券	111,194	13,890.00 1,544,484,660	14,780.00 1,643,447,320	1.63
26	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	18,497	85,700.00 1,585,192,900	87,400.00 1,616,637,800	1.60
27	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	3,179	481,000.00 1,529,099,000	490,500.00 1,559,299,500	1.55
28	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	13,804	111,000.00 1,532,244,000	110,800.00 1,529,483,200	1.52
29	産業ファンド	日本	投資証券	11,558	121,200.00 1,400,829,600	121,600.00 1,405,452,800	1.39

30	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	8,448	160,234.28 1,353,659,248	159,800.00 1,349,990,400	1.34
----	-------------------------	----	------	-------	-----------------------------	-----------------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.46%
合計	98.46%

(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30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		1,581,561,759	72.63
	内 カナダ	66,906,078	3.07
	内 アメリカ	1,514,655,681	69.56
ハイブリッド優先証券		452,006,420	20.76
	内 アメリカ	452,006,420	20.76
投資証券		47,175,973	2.17
	内 アメリカ	47,175,973	2.17
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		96,749,038	4.44
純資産総額		2,177,493,190	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30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	575	112,617.54 64,755,090	117,120.98 67,344,569	3.09
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	5,969	10,117.79 60,393,124	10,755.86 64,201,758	2.95
3	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	2,613	17,959.63 46,928,624	20,399.72 53,304,492	2.45
4	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	14,229	3,239.26 46,091,431	3,205.56 45,611,956	2.09
5	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	3,166	11,989.61 37,959,105	11,777.64 37,288,024	1.71
6	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	1,742	18,993.15 33,086,069	20,381.25 35,504,138	1.63
7	TIME WARNER INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	3,302	10,509.11 34,701,101	10,228.67 33,775,068	1.55
8	COLGATE-PALMOLIVE CO	アメリカ	株式	生活必需品	4,708	7,509.53 35,354,949	6,999.19 32,952,201	1.51
9	QUALCOMM INC	アメリカ	株式	情報技術	5,146	5,923.17 30,480,882	6,346.99 32,661,626	1.50
10	UNITED PARCEL SERVICE-CL B	アメリカ	株式	資本財・ サービス	2,529	11,773.84 29,776,142	12,684.20 32,078,349	1.47
11	STARBUCKS CORP	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	4,700	6,439.38 30,265,124	6,248.07 29,365,957	1.35
12	ORACLE CORP	アメリカ	株式	情報技術	5,434	5,008.89 27,218,341	5,114.33 27,791,296	1.28
13	INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	情報技術	1,789	17,034.37 30,474,500	15,502.79 27,734,498	1.27
14	CHUBB LTD	アメリカ	株式	金融	1,928	14,565.80 28,082,862	14,382.09 27,728,683	1.27
15	ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	2,349	12,312.77 28,922,955	11,527.63 27,078,415	1.24
16	TJX COMPANIES INC	アメリカ	株式	一般消費 財・サービ ス	2,734	8,832.96 24,149,318	9,759.08 26,681,341	1.23
17	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	2,000	14,198.39 28,396,788	13,149.43 26,298,878	1.21
18	MEDTRONIC PLC	アメリカ	株式	ヘルスケア	2,702	8,649.25 23,370,298	9,336.24 25,226,529	1.16
19	TE CONNECTIVITY LTD	アメリカ	株式	情報技術	2,435	10,753.69 26,185,238	10,212.36 24,867,109	1.14
20	BIOGEN INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	777	28,847.89 22,414,813	32,001.28 24,864,995	1.14
21	AMERIPRISE FINANCIAL INC	アメリカ	株式	金融	1,577	15,268.00 24,077,783	15,164.73 23,914,790	1.10
22	UNION PACIFIC CORP	アメリカ	株式	資本財・ サービス	1,498	15,333.43 22,969,593	15,885.41 23,796,356	1.09
23	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	1,664	13,857.94 23,059,786	14,200.56 23,629,745	1.09
24	EATON CORP PLC	アメリカ	株式	資本財・ サービス	2,690	8,398.16 22,591,056	8,468.81 22,781,118	1.05
25	UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,781	13,024.43 23,196,685	12,716.81 22,648,644	1.04

26	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	2,532	8,461.20 21,423,779	8,859.05 22,431,115	1.03
27	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	2,000	10,908.04 21,816,090	10,867.82 21,735,652	1.00
28	MORGAN STANLEY	アメリカ	株式	金融	3,905	5,758.92 22,488,606	5,540.43 21,635,414	0.99
29	AT&T INC	アメリカ	株式	電気通信サービス	5,936	3,819.71 22,673,846	3,540.35 21,015,571	0.97
30	ASSURANT INC	アメリカ	株式	金融	2,017	9,886.04 19,940,319	10,368.89 20,914,057	0.96

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	72.63%
ハイブリッド優先証券	20.76%
投資証券	2.17%
合計	95.56%

(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	5.08%
素材	2.41%
資本財・サービス	6.67%
一般消費財・サービス	8.92%
生活必需品	2.89%
ヘルスケア	10.28%
金融	12.67%
情報技術	19.77%
電気通信サービス	1.81%
公益事業	2.13%
合計	72.63%

(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30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		1,165,349,720	91.75
	内 スウェーデン	27,857,481	2.19
	内 イギリス	298,016,745	23.46
	内 オランダ	139,338,303	10.97
	内 フランス	202,973,135	15.98
	内 ドイツ	196,714,447	15.49
	内 スイス	175,983,481	13.86
	内 スペイン	29,598,470	2.33
	内 イタリア	79,950,745	6.29
	内 フィンランド	14,916,913	1.17
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		104,811,943	8.25
純資産総額		1,270,161,663	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30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	8,418.82 49,317,477	8,282.36 48,518,082	3.82
2	HSBC HOLDINGS PLC	イギリス	株式	金融	43,404	990.52 42,992,751	1,049.21 45,540,192	3.59
3	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	イギリス	株式	エネルギー	11,761	3,438.35 40,438,547	3,786.74 44,535,957	3.51
4	SCHNEIDER ELECTRIC SE	フランス	株式	資本財・サービス	4,676	8,710.15 40,728,675	9,337.46 43,661,993	3.44
5	TOTAL SA	フランス	株式	エネルギー	6,299	6,159.07 38,796,032	6,577.28 41,430,331	3.26
6	KONINKLIJKE DSM NV	オランダ	株式	素材	3,798	10,848.08 41,201,038	10,827.81 41,124,027	3.24
7	SIEMENS AG-REG	ドイツ	株式	資本財・サービス	2,800	13,288.90 37,208,942	14,350.90 40,182,535	3.16
8	PRUDENTIAL PLC	イギリス	株式	金融	14,844	2,669.30 39,623,095	2,625.20 38,968,611	3.07
9	KONINKLIJKE PHILIPS NV	オランダ	株式	ヘルスケア	8,394	4,067.39 34,141,750	4,522.36 37,960,690	2.99
10	NOVARTIS AG-REG	スイス	株式	ヘルスケア	4,389	8,603.70 37,761,679	8,200.92 35,993,864	2.83
11	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	ドイツ	株式	電気通信サービス	21,145	1,685.50 35,640,088	1,689.31 35,720,479	2.81
12	GLAXOSMITHKLINE PLC	イギリス	株式	ヘルスケア	15,900	2,052.75 32,638,757	2,204.82 35,056,783	2.76
13	BASF SE	ドイツ	株式	素材	3,218	10,660.52 34,305,578	10,891.17 35,047,805	2.76

14	GIVAUDAN-REG	スイス	株式	素材	138	238,918.55 32,970,760	243,650.70 33,623,797	2.65
15	ZURICH INSURANCE GROUP AG	スイス	株式	金融	1,034	33,818.36 34,968,189	32,508.77 33,614,068	2.65
16	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	ドイツ	株式	一般消費財・サービス	2,996	11,574.25 34,676,456	10,924.12 32,728,681	2.58
17	SANOFI	フランス	株式	ヘルスケア	3,682	8,362.91 30,792,245	8,376.85 30,843,573	2.43
18	AVIVA PLC	イギリス	株式	金融	40,669	734.65 29,877,639	737.83 30,006,980	2.36
19	ENAGAS SA	スペイン	株式	エネルギー	10,115	2,885.64 29,188,270	2,926.19 29,598,470	2.33
20	ENI SPA	イタリア	株式	エネルギー	14,849	1,955.69 29,040,149	1,963.04 29,149,295	2.29
21	ENEL SPA	イタリア	株式	公益事業	48,153	648.09 31,207,825	602.22 28,998,745	2.28
22	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	ドイツ	株式	金融	1,239	24,249.78 30,045,484	22,976.14 28,467,449	2.24
23	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	イギリス	株式	生活必需品	5,047	5,954.42 30,051,990	5,506.29 27,790,248	2.19
24	BNP PARIBAS	フランス	株式	金融	3,990	7,787.55 31,072,358	6,873.83 27,426,602	2.16
25	VODAFONE GROUP PLC	イギリス	株式	電気通信サービス	96,642	298.95 28,898,118	281.71 27,225,841	2.14
26	KONINKLIJKE KPN NV	オランダ	株式	電気通信サービス	87,929	314.41 27,646,383	294.52 25,896,894	2.04
27	ALLIANZ SE-REG	ドイツ	株式	金融	1,074	24,005.19 25,781,581	22,874.76 24,567,498	1.93
28	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	スイス	株式	ヘルスケア	1,029	23,891.85 24,584,719	23,550.70 24,233,670	1.91
29	INTESA SANPAOLO	イタリア	株式	金融	68,243	373.09 25,460,995	319.48 21,802,705	1.72
30	CARNIVAL PLC	イギリス	株式	一般消費財・サービス	3,111	6,461.83 20,102,759	7,001.04 21,780,238	1.71

(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	91.75%
合計	91.75%

(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	11.39%
素材	8.64%
資本財・サービス	8.26%
一般消費財・サービス	5.36%
生活必需品	8.74%
ヘルスケア	12.92%

金融	23.33%
情報技術	2.76%
電気通信サービス	6.99%
公益事業	3.35%
合計	91.75%

(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30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		817,406,894	96.00
	内 韓国	168,829,681	19.83
	内 中国	194,280,310	22.82
	内 台湾	145,356,756	17.07
	内 香港	62,685,447	7.36
	内 シンガポール	47,840,198	5.62
	内 オーストラリア	198,414,502	23.30
投資信託受益証券		6,718,220	0.79
	内 香港	6,718,220	0.79
投資証券		6,701,184	0.79
	内 香港	6,701,184	0.79
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		20,611,255	2.42
純資産総額		851,437,553	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30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	11,750	5,034.78 59,158,665	5,004.45 58,802,288	6.91

2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台湾	株式	情報技術	45,000	885.09 39,829,050	800.02 36,000,900	4.23
3	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	台湾	株式	電気通信サービス	86,000	283.44 24,376,356	275.12 23,660,320	2.78
4	CHINA GAS HOLDINGS LTD	中国	株式	公益事業	54,000	389.28 21,021,412	434.89 23,484,060	2.76
5	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	オーストラリア	株式	金融	3,900	6,024.72 23,496,431	5,731.56 22,353,084	2.63
6	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	中国	株式	ヘルスケア	18,500	1,095.53 20,267,398	1,204.95 22,291,575	2.62
7	QANTAS AIRWAYS LTD	オーストラリア	株式	資本財・サービス	41,000	489.98 20,089,283	527.86 21,642,404	2.54
8	MODETOUR NETWORK INC	韓国	株式	一般消費財・サービス	6,500	3,735.64 24,281,693	3,149.26 20,470,223	2.40
9	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	香港	株式	一般消費財・サービス	21,000	981.96 20,621,265	945.26 19,850,513	2.33
10	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	韓国	株式	ヘルスケア	440	57,627.00 25,355,880	43,018.05 18,927,942	2.22
11	BHP BILLITON LIMITED	オーストラリア	株式	素材	7,100	2,448.26 17,382,685	2,651.67 18,826,857	2.21
12	UNITED OVERSEAS BANK LTD	シンガポール	株式	金融	8,100	2,293.08 18,574,013	2,302.83 18,652,939	2.19
13	MACQUARIE GROUP LTD	オーストラリア	株式	金融	2,000	8,581.69 17,163,387	9,326.13 18,652,275	2.19
14	KIWOOM SECURITIES CO LTD	韓国	株式	金融	1,500	11,575.95 17,363,925	12,384.75 18,577,125	2.18
15	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	台湾	株式	資本財・サービス	12,000	1,828.10 21,937,200	1,525.83 18,309,960	2.15
16	ALUMINA LTD	オーストラリア	株式	素材	82,000	213.28 17,489,493	215.75 17,692,074	2.08
17	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	台湾	株式	金融	92,000	191.13 17,584,512	191.49 17,617,816	2.07
18	WESTPAC BANKING CORP	オーストラリア	株式	金融	7,500	2,379.09 17,843,186	2,293.44 17,200,856	2.02
19	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	情報技術	3,100	5,650.80 17,517,480	5,470.75 16,959,325	1.99
20	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	中国	株式	不動産	80,000	229.07 18,326,320	210.24 16,819,440	1.98
21	GENTING SINGAPORE PLC	シンガポール	株式	一般消費財・サービス	163,600	95.81 15,675,498	101.50 16,605,400	1.95
22	POSCO	韓国	株式	素材	470	33,110.25 15,561,818	34,576.20 16,250,814	1.91
23	TIMES CHINA HOLDINGS LTD	中国	株式	不動産	99,000	160.92 15,932,419	162.04 16,042,455	1.88
24	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	中国	株式	エネルギー	156,000	105.14 16,405,210	100.13 15,621,138	1.83
25	WYNN MACAU LTD	香港	株式	一般消費財・サービス	36,000	417.57 15,032,790	407.19 14,658,840	1.72
26	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	中国	株式	素材	210,000	80.46 16,898,385	67.44 14,164,395	1.66

27	3SBIO INC	中国	株式	ヘルスケア	47,000	257.88 12,120,689	299.16 14,060,520	1.65
28	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	オーストラリア	株式	金融	6,000	2,348.62 14,091,732	2,206.98 13,241,880	1.56
29	INSURANCE AUSTRALIA GROUP	オーストラリア	株式	金融	19,600	670.32 13,139,580	664.56 13,025,464	1.53
30	POSCO DAEWOO CORP	韓国	株式	資本財・サービス	5,544	2,320.39 12,864,246	2,315.19 12,835,413	1.51

(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	96.00%
投資信託受益証券	0.79%
投資証券	0.79%
合計	97.58%

(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	3.66%
素材	10.08%
資本財・サービス	9.10%
一般消費財・サービス	9.65%
ヘルスケア	10.72%
金融	23.00%
情報技術	17.95%
電気通信サービス	2.78%
公益事業	2.76%
不動産	6.31%
合計	96.00%

(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30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		19,274,659,950	94.00
	内 日本	19,274,659,950	94.00

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,229,292,619	6.00
純資産総額	20,503,952,569	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引(買建)	610,575,000	2.98
内 日本	610,575,000	2.98

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

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

(注3) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

(2) 投資資産(平成30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	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	157,500	4,515.00 711,112,500	4,503.00 709,222,500	3.46
2	三菱商事	日本	株式	卸売業	200,000	2,916.50 583,300,000	3,031.00 606,200,000	2.96
3	伊藤忠	日本	株式	卸売業	285,000	2,112.77 602,140,428	2,046.00 583,110,000	2.84
4	大和ハウス	日本	株式	建設業	145,000	4,056.27 588,159,767	3,947.00 572,315,000	2.79
5	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	850,000	712.50 605,625,000	655.80 557,430,000	2.72
6	三井物産	日本	株式	卸売業	205,000	1,853.86 380,041,622	1,917.00 392,985,000	1.92
7	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	55,000	6,936.00 381,480,000	6,921.00 380,655,000	1.86
8	住友鉱山	日本	株式	非鉄金属	77,500	4,408.89 341,689,558	4,166.00 322,865,000	1.57
9	電通	日本	株式	サービス業	57,500	4,964.86 285,479,468	5,200.00 299,000,000	1.46
10	武田薬品	日本	株式	医薬品	65,000	4,607.83 299,509,443	4,452.00 289,380,000	1.41
11	住友商事	日本	株式	卸売業	155,000	1,851.00 286,905,000	1,827.50 283,262,500	1.38
12	三菱自動車工業	日本	株式	輸送用機器	340,000	769.81 261,738,945	824.00 280,160,000	1.37
13	東京海上HD	日本	株式	保険業	52,500	4,927.00 258,667,500	5,240.00 275,100,000	1.34
14	みずほフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	1,450,000	194.80 282,460,000	189.70 275,065,000	1.34
15	東海カーボン	日本	株式	ガラス・土石製品	120,000	1,357.89 162,947,920	2,233.00 267,960,000	1.31

16	KDDI	日本	株式	情報・通信業	90,000	2,828.50 254,565,130	2,945.50 265,095,000	1.29
17	東京エレクトロン	日本	株式	電気機器	12,500	20,596.05 257,450,652	20,400.00 255,000,000	1.24
18	大塚ホールディングス	日本	株式	医薬品	45,000	5,389.63 242,533,490	5,419.00 243,855,000	1.19
19	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	47,500	5,129.33 243,643,620	5,106.00 242,535,000	1.18
20	小松製作所	日本	株式	機械	67,500	3,640.47 245,731,917	3,587.00 242,122,500	1.18
21	本田技研	日本	株式	輸送用機器	70,000	3,782.00 264,740,000	3,447.00 241,290,000	1.18
22	デンソー	日本	株式	輸送用機器	42,500	5,819.00 247,307,500	5,290.00 224,825,000	1.10
23	キヤノン	日本	株式	電気機器	60,000	3,883.00 232,980,000	3,714.00 222,840,000	1.09
24	三菱電機	日本	株式	電気機器	140,000	1,694.00 237,160,000	1,545.00 216,300,000	1.05
25	オリックス	日本	株式	その他金融業	115,000	1,868.78 214,909,824	1,826.50 210,047,500	1.02
26	NTTドコモ	日本	株式	情報・通信業	72,500	2,765.86 200,525,226	2,818.00 204,305,000	1.00
27	住友化学	日本	株式	化学	310,000	621.89 192,788,684	659.00 204,290,000	1.00
28	任天堂	日本	株式	その他製品	4,500	44,670.00 201,015,000	45,000.00 202,500,000	0.99
29	三菱ケミカルHLDGS	日本	株式	化学	200,000	1,037.53 207,507,386	1,008.00 201,600,000	0.98
30	MS & AD	日本	株式	保険業	57,500	3,531.00 203,032,500	3,464.00 199,180,000	0.97

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	94.00%
合計	94.00%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	4.42%
食料品	0.57%
繊維製品	0.47%
化学	10.58%
医薬品	4.61%
石油・石炭製品	1.12%
ゴム製品	0.40%
ガラス・土石製品	2.87%
鉄鋼	0.49%
非鉄金属	2.77%
金属製品	1.58%

機械	6.19%
電気機器	7.21%
輸送用機器	7.98%
精密機器	0.27%
その他製品	1.69%
陸運業	1.09%
空運業	0.62%
情報・通信業	5.22%
卸売業	12.61%
小売業	1.09%
銀行業	9.23%
証券、商品先物取引業	1.48%
保険業	4.26%
その他金融業	1.37%
不動産業	0.99%
サービス業	2.80%
合計	94.00%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
株価指数先物 取引	日本	TOPIX先物 2018年6月	買建	35	607,950,000	610,575,000	2.98%

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

(注2) 株価指数先物取引の時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

【インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【投資状況】（平成30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	859,704,994	99.14
内 日本	859,704,994	99.14
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	7,446,174	0.86
純資産総額	867,151,168	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30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	371,710,519	1.6501 613,359,527	1.6291 605,553,606	69.83
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	28,093,756	3.0430 85,489,300	2.9902 84,005,949	9.69
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	19,940,781	2.2182 44,232,640	2.2028 43,925,552	5.07
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	17,699,483	2.4512 43,386,742	2.4575 43,496,479	5.02
5	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	12,431,375	2.2682 28,196,844	2.2473 27,937,029	3.22
6	ダイワ北米好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	11,163,793	2.4996 27,906,133	2.5004 27,913,948	3.22
7	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	日本	親投資信託受益証券	16,824,713	1.6822 28,302,532	1.5972 26,872,431	3.10

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

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	99.14%
合計	99.14%

(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
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
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
平成29年5月末日	1,035,971,589	-	0.8505	-
6月末日	1,042,578,528	-	0.8659	-
7月末日	1,028,362,207	-	0.8685	-
8月末日	1,019,140,431	-	0.8743	-
9月末日	1,005,942,744	-	0.8869	-
10月末日	943,166,396	-	0.8903	-
第24特定期間末 (平成29年11月10日)	944,076,847	945,657,477	0.8959	0.8974
11月末日	930,992,763	-	0.8928	-
12月末日	939,213,560	-	0.9074	-
平成30年1月末日	921,982,748	-	0.8915	-
2月末日	883,023,852	-	0.8610	-
3月末日	877,745,461	-	0.8552	-
4月末日	886,130,099	-	0.8664	-

第25特定期間末 (平成30年5月10日)	882,622,419	884,155,888	0.8634	0.8649
5月末日	867,151,168	-	0.8518	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第24特定期間	0.0045
第25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
第24特定期間	5.5
第25特定期間	3.1

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第24特定期間	10,558,332	183,081,271
第25特定期間	12,683,654	44,124,014

(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30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	4,514,095,723	99.15
内 日本	4,514,095,723	99.15
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	38,804,467	0.85
純資産総額	4,552,900,190	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30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	529,241,324	3.0430 1,610,481,353	2.9902 1,582,537,407	34.76

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	555,747,381	1.6500 917,030,256	1.6291 905,368,058	19.89
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	213,776,635	2.4997 534,377,459	2.5004 534,527,098	11.74
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	231,633,968	2.2682 525,392,172	2.2473 520,551,016	11.43
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	319,970,190	1.6822 538,253,854	1.5972 511,056,387	11.22
6	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	93,710,648	2.4513 229,712,912	2.4575 230,293,917	5.06
7	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	104,304,449	2.2182 231,368,130	2.2028 229,761,840	5.05

(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	99.15%
合計	99.15%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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
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
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
平成29年5月末日	5,125,519,414	-	0.9354	-
6月末日	5,147,433,818	-	0.9555	-
7月末日	5,052,902,539	-	0.9580	-
8月末日	4,988,137,914	-	0.9605	-
9月末日	5,027,141,187	-	0.9868	-
10月末日	5,047,350,947	-	1.0101	-
第24特定期間末 (平成29年11月10日)	5,057,631,350	5,077,504,216	1.0180	1.0220
11月末日	4,979,416,310	-	1.0146	-
12月末日	5,014,316,660	-	1.0366	-
平成30年1月末日	4,953,051,165	-	1.0282	-
2月末日	4,742,121,566	-	0.9896	-
3月末日	4,591,163,822	-	0.9630	-
4月末日	4,658,833,659	-	0.9844	-
第25特定期間末 (平成30年5月10日)	4,653,393,092	4,672,305,292	0.9842	0.9882
5月末日	4,552,900,190	-	0.9680	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第24特定期間	0.0120
第25特定期間	0.0170

(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
第24特定期間	8.5
第25特定期間	1.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
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
第24特定期間	54,376,920	654,118,402
第25特定期間	42,388,187	282,554,834

(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

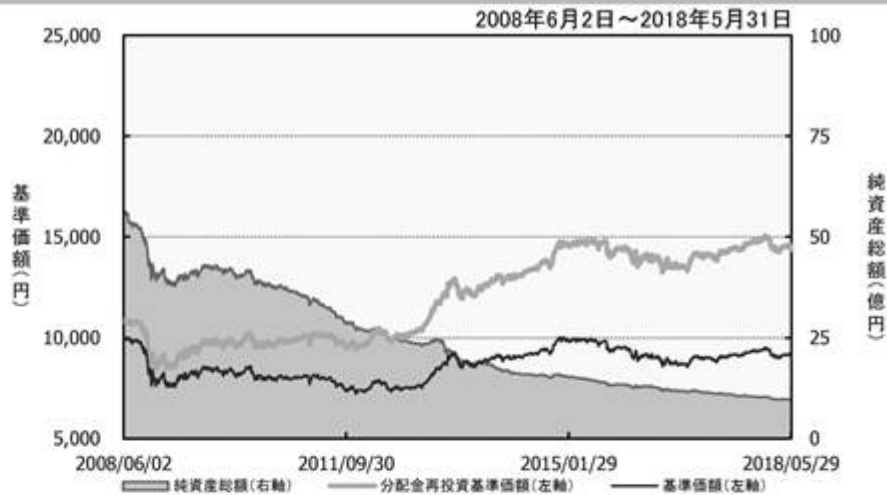
●安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)

2018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	9,071円
純資産総額	9.5億円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-0.8%
3カ月間	-0.4%
6カ月間	-2.4%
1年間	1.4%
3年間	-3.1%
5年間	14.9%
設定来	44.3%

※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: 90円 設定来分配金合計額: 4,095円

決算期	第64期	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期	第72期	第73期	第74期	第75期
	16年7月	16年9月	16年11月	17年1月	17年3月	17年5月	17年7月	17年9月	17年11月	18年1月	18年3月	18年5月
分配金	35円	35円	35円	25円	25円	25円	15円	15円	15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を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	37	34.9%	日本円	51.2%	直接利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	0.3%	
外国債券	36	33.8%	米ドル	14.1%	最終利回り(%)	TOPIX先物 3006月	日本	0.3%	
国内株式・先物	148	9.4%	ユーロ	10.2%	修正デュレーション	三菱商事	日本	0.3%	
外国株式	166	8.3%	カナダ・ドル	6.0%	残存年数	伊藤忠	日本	0.3%	
外国リート等	143	5.6%	英ポンド	5.3%	債券格付別構成	大和ハウス	日本	0.3%	
国内リート	50	4.8%	豪ドル	4.6%	AAA	87.8%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
外国投資信託等	2	0.1%	ポーランド・ズロチ	2.5%	AA	5.4%	野村不動産マスターF	日本	0.3%
			スウェーデン・クローネ	1.3%	A	6.8%	大和ハウスリート投資法人	日本	0.2%
			香港ドル	1.2%	BBB	-	日本ビルファンド	日本	0.2%
			その他	3.8%	BB	-	日本プロロジスリート	日本	0.2%
コール・ローン、その他		3.4%							
合計	582	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	2.9%	

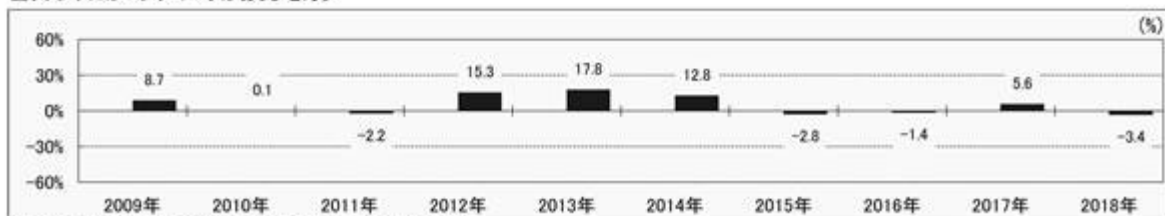
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2018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

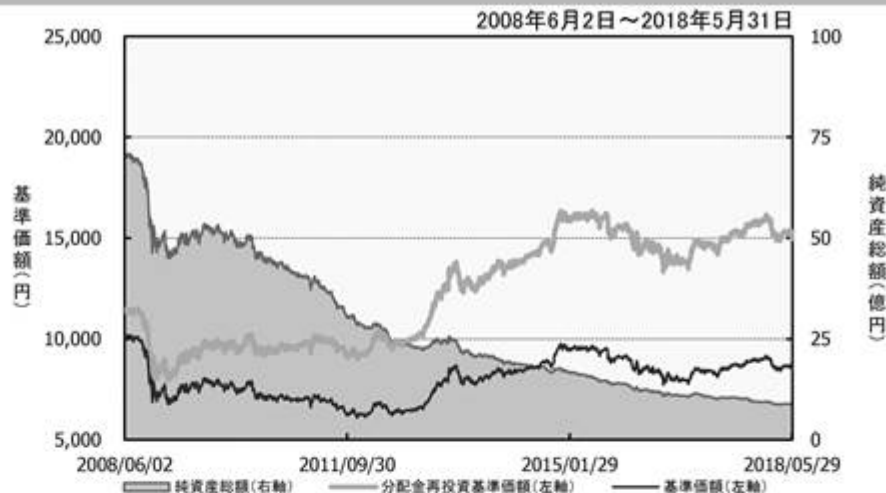
●インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)

2018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	8,518円
純資産総額	8.6億円



基準価額の騰落率

期間	ファンド
1カ月間	-1.5%
3カ月間	-0.7%
6カ月間	-4.1%
1年間	1.2%
3年間	-7.4%
5年間	13.5%
設定来	50.8%

※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 90円 設定来分配金合計額: 4,725円

決算期	第64期	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期	第72期	第73期	第74期	第75期
	16年7月	16年9月	16年11月	17年1月	17年3月	17年5月	17年7月	17年9月	17年11月	18年1月	18年3月	18年5月
分配金	25円	25円	25円	15円	15円	15円	15円	15円	15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	36	68.2%	米ドル	22.7%	直接利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	0.3%	
国内株式・先物	148	9.4%	ユーロ	18.1%	最終利回り(%)	TOPIX先物 3006月	日本	0.3%	
外国株式	166	8.3%	日本円	16.0%	修正デュレーション	三菱商事	日本	0.3%	
外国リート等	143	5.6%	カナダ・ドル	11.9%	残存年数	伊藤忠	日本	0.3%	
国内リート	50	4.9%	英ポンド	9.2%	債券格付別構成	大和ハウス	日本	0.3%	
外国投資信託等	2	0.1%	豪ドル	7.7%	AAA	75.1%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
			ポーランド・ズロチ	5.0%	AA	11.0%	野村不動産マスターF	日本	0.3%
			スウェーデン・クローネ	2.6%	A	13.9%	大和ハウスリート投資法人	日本	0.2%
			デンマーク・クローネ	1.9%	BBB	-	日本ビルファンド	日本	0.2%
コール・ローン、その他		3.8%	その他	4.9%	BB	-	日本プロロジスリート	日本	0.2%
合計	545	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	2.9%	

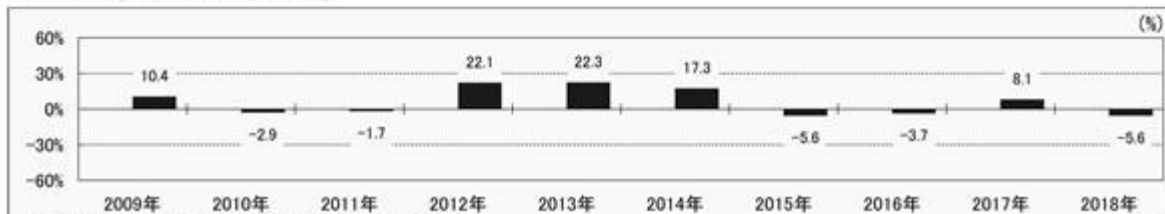
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2018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)

2018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	9,680円
純資産総額	45億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-1.3%
3カ月間	-1.4%
6カ月間	-3.0%
1年間	6.5%
3年間	0.3%
5年間	39.8%
設定来	80.2%



※上記の「基準価額の騰落率」とは、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

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

分配の推移(10,000口当たり、税引前)

直近1年間分配金合計額: 290円 設定来分配金合計額: 5,600円

決算期	第64期	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期	第72期	第73期	第74期	第75期
	16年7月	16年9月	16年11月	17年1月	17年3月	17年5月	17年7月	17年9月	17年11月	18年1月	18年3月	18年5月
分配金	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	40円	90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を分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。

主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
国内株式・先物	148	33.7%	日本円	41.6%	直接利回り(%)	三井住友フィナンシャルG	日本	1.2%	
外国株式	166	29.8%	米ドル	18.6%	最終利回り(%)	TOPIX先物 3006月	日本	1.0%	
外国債券	36	19.4%	ユーロ	11.4%	修正デュレーション	三菱商事	日本	1.0%	
外国リート等	143	7.6%	英ポンド	5.5%	残存年数	伊藤忠	日本	1.0%	
国内リート	50	5.0%	豪ドル	5.2%	債券格付別構成	大和ハウス	日本	1.0%	
外国投資信託等	2	0.2%	カナダ・ドル	3.9%	AAA	75.1%	ジャパンリアルエステイト	日本	0.4%
			香港ドル	3.6%	AA	11.0%	野村不動産マスターF	日本	0.3%
			韓国ウォン	2.3%	A	13.9%	大和ハウスリート投資法人	日本	0.3%
			台湾ドル	2.0%	BBB	-	日本ビルファンド	日本	0.2%
コール・ローン、その他		5.4%	その他	5.9%	BB	-	日本プロロジスリート	日本	0.2%
合計	545	-	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	6.7%	

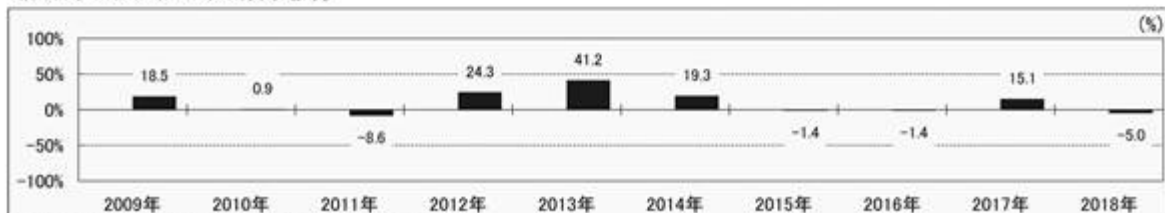
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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。

※先物の建玉がある場合は、資産別構成の比率合計欄を表示していません。

年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2018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29年11月11日から平成30年5月10日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 【財務諸表】

【安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【貸借対照表】

	前 期		当 期	
	平成29年11月10日現在		平成30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		13,144,896		13,868,453
親投資信託受益証券		1,023,936,157		957,444,142
未収入金		4,000,000		-
流動資産合計		1,041,081,053		971,312,595
資産合計		1,041,081,053		971,312,595
負債の部				
流動負債				
未払収益分配金		1,659,850		1,586,273
未払解約金		2,353,457		-
未払受託者報酬		93,150		84,905
未払委託者報酬		2,142,842		1,953,338
その他未払費用		43,629		40,239
流動負債合計		6,292,928		3,664,755
負債合計		6,292,928		3,664,755
純資産の部				
元本等				
元本	1	1,106,566,768		1,057,515,726
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	71,778,643		89,867,886
（分配準備積立金）		8,254,075		11,254,300
元本等合計		1,034,788,125		967,647,840
純資産合計		1,034,788,125		967,647,840
負債純資産合計		1,041,081,053		971,312,595

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 平成29年5月11日 至 平成29年11月10日	自 平成29年11月11日 至 平成30年5月10日
	金 額（円）	金 額（円）
営業収益		
有価証券売買等損益	44,543,483	10,492,015
営業収益合計	44,543,483	10,492,015
営業費用		
支払利息	3,337	3,102
受託者報酬	291,410	268,059
委託者報酬	6,703,524	6,166,685
その他費用	43,629	40,248
営業費用合計	7,041,900	6,478,094
営業利益又は営業損失（ ）	37,501,583	16,970,109
経常利益又は経常損失（ ）	37,501,583	16,970,109
当期純利益又は当期純損失（ ）	37,501,583	16,970,109
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	919,375	514,267
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	114,839,858	71,778,643
剰余金増加額又は欠損金減少額	16,029,670	4,624,122
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	16,029,670	4,624,122
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,361,900	1,429,298
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	4,361,900	1,429,298
分配金	5,188,763	4,828,225
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	71,778,643	89,867,886

(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29年11月11日	至 平成30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29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
1. 1 期首元本額	1,237,933,700円	1,106,566,768円
期中追加設定元本額	50,120,711円	19,575,536円
期中一部解約元本額	181,487,643円	68,626,578円
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,106,566,768口	1,057,515,726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71,778,643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89,867,886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29年5月11日 至 平成29年11月10日	自 平成29年11月11日 至 平成30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	303,049円	275,664円
2. 2 分配金の計算過程	（自平成29年5月11日 至平成29年7月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（3,770,020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（566,380円）及び分配準備積立金（4,600,384円）より分配対象額は8,936,784円（1万口当たり74.80円）であり、うち1,792,174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11月11日 至平成30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（3,326,314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（777,947円）及び分配準備積立金（8,061,099円）より分配対象額は12,165,360円（1万口当たり111.52円）であり、うち1,636,311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29年7月11日 至平成29年9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(1,687,575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(680,872円)及び分配準備積立金(6,260,101円)より分配対象額は8,628,548円(1万口当たり74.52円)であり、うち1,736,739円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成29年9月12日 至平成29年11月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,018,146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(701,326円)及び分配準備積立金(5,895,779円)より分配対象額は10,615,251円(1万口当たり95.93円)であり、うち1,659,850円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成30年1月11日 至平成30年3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(1,450,369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(817,580円)及び分配準備積立金(9,518,025円)より分配対象額は11,785,974円(1万口当たり110.11円)であり、うち1,605,641円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p> <p>(自平成30年3月13日 至平成30年5月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,622,030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(842,995円)及び分配準備積立金(9,218,543円)より分配対象額は13,683,568円(1万口当たり129.39円)であり、うち1,586,273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29年11月11日 至 平成30年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 平成30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29年11月10日現在	当 期 平成30年5月10日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	26,394,852	9,704,444
合計	26,394,852	9,704,444

(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29年11月10日現在	当 期 平成30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29年11月11日 至 平成30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29年11月10日現在	当 期 平成30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)	0.9351円 (9,351円)	0.9150円 (9,150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	202,104,970	333,493,410	
	ダイワ日本国債マザーファンド	268,446,677	336,900,579	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	21,841,248	48,448,256	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	31,641,606	96,285,407	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	12,748,365	31,867,087	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	18,843,762	31,698,976	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	13,647,901	30,956,169	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	19,497,515	47,794,258	
親投資信託受益証券 合計		957,444,142		
合計		957,444,142		

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

(参考)

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本国債マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの特定期間末日(以下、「期末日」)における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	1,173,989,588	310,891,495
コール・ローン	63,959,349	27,903,769
国債証券	30,443,689,090	28,933,939,174
特殊債券	1,040,458,709	964,776,044
派生商品評価勘定	7,325,168	16,524,067
未収入金	77,234,055	54,224,025
未収利息	261,891,140	216,074,934
前払費用	9,745,024	14,029,887
差入委託証拠金	252,176,156	130,179,417
流動資産合計	33,330,468,279	30,668,542,812
資産合計	33,330,468,279	30,668,542,812
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,955,479	262,000
未払解約金	95,772,452	30,587,264
その他未払費用	-	654
流動負債合計	98,727,931	30,849,918
負債合計	98,727,931	30,849,918
純資産の部		
元本等		
元本	1 19,354,980,293	18,567,565,077
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,876,760,055	12,070,127,817
元本等合計	33,231,740,348	30,637,692,894
純資産合計	33,231,740,348	30,637,692,894
負債純資産合計	33,330,468,279	30,668,542,812

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29年11月11日 至 平成30年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認め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>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<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29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
<p>1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額</p>	<p>平成29年5月11日 20,609,366,208円 1,642,401,946円 2,896,787,861円</p>	<p>平成29年11月11日 19,354,980,293円 429,202,071円 1,216,617,287円</p>
<p>期末元本額の内訳 ファンド名</p>		
<p>ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）</p>	1,958,107,938円	1,835,807,148円
<p>富山応援ファンド（地域企業株・外債バランス／毎月分配型）</p>	682,350,416円	669,890,631円
<p>ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）</p>	1,074,070,316円	1,021,465,208円
<p>ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）</p>	53,366,620円	50,538,318円
<p>安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）</p>	209,270,385円	202,104,970円
<p>インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）</p>	382,384,662円	371,710,519円
<p>成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）</p>	577,864,795円	555,136,208円
<p>京都応援バランスファンド（隔月分配型）</p>	247,910,310円	240,681,260円
<p>6資産バランスファンド（分配型）</p>	1,224,450,110円	1,155,955,447円
<p>6資産バランスファンド（成長型）</p>	127,996,592円	125,587,307円
<p>ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）</p>	8,496,476,026円	8,008,419,707円
<p>世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）</p>	76,524,018円	72,303,103円
<p>ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）</p>	401,796,210円	361,047,119円
<p>兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）</p>	910,658,000円	1,014,869,035円

『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	28,784,083円	25,938,332円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	306,826,399円	292,008,408円
紀陽地域株式・外債バランスファンド（隔月分配型）	58,565,078円	56,186,135円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	1,245,368,313円	1,160,258,970円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（1年決算型）	17,100,172円	16,937,952円
四国アライアンス 地域創生ファンド（年1回決算型）	871,365,165円	913,242,950円
四国アライアンス 地域創生ファンド（年2回決算型）	403,744,685円	417,476,350円
計	19,354,980,293円	18,567,565,077円
2. 期末日における受益権の総数	19,354,980,293口	18,567,565,077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29年11月11日 至 平成30年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。 信託財産の効率的な運用に資すること、および外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30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29年11月10日現在	平成30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	215,395,673	287,725,616
特殊債券	14,312,516	11,099,311
合計	229,708,189	298,824,927

(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29年10月11日から平成29年11月10日まで、及び平成30年4月11日から平成30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29年11月10日 現在				平成30年5月10日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	1,900,172,320	-	1,893,115,000	7,057,320	1,724,844,000	-	1,716,604,000	8,240,000
アメリカ・ドル	-	-	-	-	43,710,000	-	43,972,000	262,000
イギリス・ポンド	44,853,120	-	44,706,000	147,120	-	-	-	-
オーストラリア・ドル	1,312,350,000	-	1,305,300,000	7,050,000	1,233,150,000	-	1,229,850,000	3,300,000
ノルウェー・クローネ	27,935,200	-	27,880,000	55,200	-	-	-	-
ユーロ	515,034,000	-	515,229,000	195,000	447,984,000	-	442,782,000	5,202,000
買 建	1,827,384,000	-	1,824,696,369	2,687,631	1,681,134,000	-	1,689,156,067	8,022,067
カナダ・ドル	1,312,350,000	-	1,309,589,521	2,760,479	1,233,150,000	-	1,233,973,200	823,200
スウェーデン・クローナ	515,034,000	-	515,106,848	72,848	447,984,000	-	455,182,867	7,198,867
合計	3,727,556,320	-	3,717,811,369	4,369,689	3,405,978,000	-	3,405,760,067	16,262,067

(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29年11月10日現在	平成30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)	1.7170円 (17,170円)	1.6501円 (16,501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	1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	2,500,000.000	2,465,325.000		
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	8,000,000.000	7,611,840.000		
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	45,000,000.000	40,766,850.000		
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	7,400,000.000	6,509,040.000		
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	7,200,000.000	6,932,232.000		
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	2,300,000.000	2,187,323.000		
		アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 66,472,610.000 (7,309,328,196)	
	イギリス・ポンド		1.5% United Kingdom Gilt 20210122	3,500,000.000	3,559,115.000	
			1.5% United Kingdom Gilt 20260722	4,500,000.000	4,539,870.000	
			5% United Kingdom Gilt 20250307	9,300,000.000	11,566,782.000	
			4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	1,520,700.000	
			4% United Kingdom Gilt 20220307	1,500,000.000	1,671,135.000	
	イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 22,857,602.000 (3,403,496,938)		
	オーストラリア・ドル		5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	8,000,000.000	8,831,120.000	
			4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	6,800,000.000	7,874,400.000	
			4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	24,000,000.000	28,451,280.000	
	オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 45,156,800.000 (3,704,663,872)		
	カナダ・ドル		3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,500,000.000	1,813,155.000	

	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	19,000,000.000	18,905,570.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	13,500,000.000	12,658,275.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 33,377,000.000 (2,856,737,429)	
スウェーデン・ク ローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	6,800,000.000	7,759,548.000	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	36,000,000.000	38,747,520.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 46,507,068.000 (586,919,198)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,500,000.000	9,159,755.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	34,000,000.000	37,652,280.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 46,812,035.000 (818,274,372)	
ノルウェー・ク ローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	25,500,000.000	27,473,700.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	4,000,000.000	4,103,000.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	20,000,000.000	21,583,200.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 53,159,900.000 (723,506,239)	
ポーランド・ズロ チ	2.25% Poland Government Bond 20220425	27,000,000.000	27,024,300.000	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	39,000,000.000	43,814,550.000	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 70,838,850.000 (2,164,126,867)	
ユーロ	1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	2,800,000.000	3,017,756.000	
	2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,500,000.000	1,963,710.000	
	3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	5,200,000.000	7,120,360.000	
	3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,500,000.000	2,216,385.000	
	5.4% IRISH TREASURY 20250313	5,900,000.000	7,854,021.000	
	1% IRISH TREASURY 20260515	8,000,000.000	8,199,440.000	
	1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	15,000,000.000	16,104,300.000	
	1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	10,000,000.000	10,092,300.000	
ユーロ 小計			ユーロ 56,568,272.000 (7,366,886,063)	
国債証券 合計			28,933,939,174	

				[28,933,939,174]
特殊債券	カナダ・ドル	2.55% CANADA HOUSING TRUST 20250315	カナダ・ドル 4,500,000.000	カナダ・ドル 4,475,835.000
		2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	7,000,000.000	6,796,230.000
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 11,272,065.000 (964,776,044)
特殊債券 合計				964,776,044 [964,776,044]
合計				29,898,715,218 [29,898,715,218]

- (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 6銘柄	100%	24.4%
イギリス・ポンド	国債証券 5銘柄	100%	11.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 3銘柄	100%	12.4%
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄	100%	12.8%
	特殊債券 2銘柄		
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	100%	2.0%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	100%	2.7%
ノルウェー・クローネ	国債証券 3銘柄	100%	2.4%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	100%	7.2%
ユーロ	国債証券 8銘柄	100%	24.7%

第2 信用取引契約残高明細表
 該当事項はありません。

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

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成29年11月10日現在	平成30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	873,727,813	784,712,754
国債証券	324,548,665,000	284,883,804,320
未収利息	1,598,392,704	1,517,459,460
前払費用	133,973,798	143,512,350
流動資産合計	327,154,759,315	287,329,488,884
資産合計	327,154,759,315	287,329,488,884
負債の部		
流動負債		
未払解約金	218,143,184	184,786,888
その他未払費用	-	6,018
流動負債合計	218,143,184	184,792,906
負債合計	218,143,184	184,792,906
純資産の部		
元本等		
元本	1 260,830,303,985	228,808,472,826
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	66,106,312,146	58,336,223,152
元本等合計	326,936,616,131	287,144,695,978
純資産合計	326,936,616,131	287,144,695,978
負債純資産合計	327,154,759,315	287,329,488,884

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29年11月11日 至 平成30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29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
1. 1 期首	平成29年5月11日	平成29年11月11日
期首元本額	288,655,416,388円	260,830,303,985円
期中追加設定元本額	3,120,875,560円	1,381,605,693円
期中一部解約元本額	30,945,987,963円	33,403,436,852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）	6,786,270円	6,783,024円
安定重視ポートフォリオ（奇 数月分配型）	286,790,629円	268,446,677円
6資産バランスファンド（分 配型）	333,584,919円	303,281,429円
6資産バランスファンド（成 長型）	174,188,506円	165,422,344円
ダイワ日本国債ファンド（毎 月分配型）	248,695,530,351円	216,605,288,813円
世界6資産均等分散ファンド （毎月分配型）	104,840,844円	95,280,529円
ダイワ・株/債券/コモディ ティ・バランスファンド	54,841,878円	45,281,449円
ダイワ日本国債ファンド（年1 回決算型）	10,872,011,410円	11,068,617,162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）	301,729,178円	250,071,399円
計	260,830,303,985円	228,808,472,826円
2. 期末日における受益権の総数	260,830,303,985口	228,808,472,826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29年11月11日 至 平成30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30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29年11月10日現在	平成30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	2,752,363,190	954,875,840
合計	2,752,363,190	954,875,840

（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29年3月11日から平成29年11月10日まで、及び平成30年3月13日から平成30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29年11月10日現在	平成30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29年11月10日現在	平成30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）	1.2534円 (12,534円)	1.2550円 (12,550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	1 30年国債	13,250,000,000	17,278,662,500	
	2 30年国債	1,470,000,000	1,859,329,500	
	4 30年国債	14,300,000,000	19,135,974,000	
	5 30年国債	3,600,000,000	4,534,092,000	
	6 30年国債	11,050,000,000	14,280,357,000	
	7 30年国債	14,950,000,000	19,206,564,000	
	40 20年国債	9,402,000,000	9,485,113,680	
	42 20年国債	9,548,000,000	9,772,950,880	
	43 20年国債	13,872,000,000	14,446,300,800	
	44 20年国債	4,245,000,000	4,452,877,650	
	48 20年国債	15,901,000,000	16,995,465,830	
	49 20年国債	1,968,000,000	2,093,814,240	
	52 20年国債	3,268,000,000	3,513,067,320	
	54 20年国債	12,387,000,000	13,426,764,780	
	55 20年国債	1,904,000,000	2,059,728,160	
	56 20年国債	10,420,000,000	11,325,289,600	
	58 20年国債	3,325,000,000	3,617,101,250	
	59 20年国債	3,595,000,000	3,894,751,100	
	63 20年国債	1,500,000,000	1,645,935,000	
	64 20年国債	4,500,000,000	4,981,095,000	
	65 20年国債	4,500,000,000	5,002,155,000	
	68 20年国債	6,325,000,000	7,171,538,000	
	70 20年国債	10,838,000,000	12,476,705,600	
74 20年国債	265,000,000	302,789,000		

75	20年国債	5,474,000,000	6,281,633,960	
80	20年国債	4,173,000,000	4,811,427,270	
82	20年国債	1,965,000,000	2,275,470,000	
83	20年国債	3,300,000,000	3,837,636,000	
86	20年国債	6,700,000,000	7,926,368,000	
88	20年国債	3,760,000,000	4,468,534,400	
91	20年国債	6,000,000,000	7,159,860,000	
92	20年国債	2,970,000,000	3,505,550,400	
94	20年国債	3,300,000,000	3,910,335,000	
95	20年国債	7,405,000,000	8,940,204,600	
101	20年国債	8,160,000,000	10,045,857,600	
102	20年国債	7,800,000,000	9,638,850,000	
106	20年国債	7,480,000,000	9,123,655,200	
国債証券 合計			284,883,804,320	
合計			284,883,804,320	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	3,561,201,326	3,405,968,226
コール・ローン	574,785,624	471,774,309
投資証券	109,367,225,163	99,598,572,707
派生商品評価勘定	1,337,600	1,736,777
未収入金	1,176,823,730	571,787,483
未収配当金	76,517,942	103,932,055
流動資産合計	114,757,891,385	104,153,771,557
資産合計	114,757,891,385	104,153,771,557
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	29,526	3,281,250
未払金	583,554,946	644,020,908
未払解約金	207,471,000	167,169,000
その他未払費用	-	5,868
流動負債合計	791,055,472	814,477,026
負債合計	791,055,472	814,477,026
純資産の部		
元本等		
元本	1 50,479,606,173	46,587,701,912
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	63,487,229,740	56,751,592,619
元本等合計	113,966,835,913	103,339,294,531
純資産合計	113,966,835,913	103,339,294,531
負債純資産合計	114,757,891,385	104,153,771,557

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29年11月11日 至 平成30年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	<p>平成29年5月11日 55,951,639,750円 198,046,015円 5,670,079,592円</p>	<p>平成29年11月11日 50,479,606,173円 248,609,878円 4,140,514,139円</p>
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルREI	45,751,633,422円	42,052,129,416円
T・オープン(毎月分配型)		
ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	41,308,184円	39,191,006円
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	22,685,685円	21,841,248円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	20,821,653円	19,940,781円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	112,338,463円	105,666,476円
6資産バランスファンド(分配型)	188,641,849円	174,962,260円
6資産バランスファンド(成長型)	398,877,731円	391,314,722円
りそな ワールド・リート・ファンド	1,956,387,228円	1,833,012,918円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	59,604,891円	55,553,073円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	5,476,313円	5,021,541円
常陽3分法ファンド	291,825,337円	266,083,778円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	68,034,754円	63,977,983円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	202,334,184円	223,939,720円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	272,962,830円	302,313,866円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	338,056,398円	373,218,728円
ダイワ・グローバルREITファンド(ダイワSMA専用)	111,782,297円	48,995,483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)	571,004,297円	542,731,789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)	28,467,162円	29,008,847円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド(為替ヘッジなし)	37,363,495円	38,798,277円
計	50,479,606,173円	46,587,701,912円
2. 期末日における受益権の総数	50,479,606,173口	46,587,701,912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29年11月11日 至 平成30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30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29年11月10日現在	平成30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	2,201,119,027	3,455,859,776
合計	2,201,119,027	3,455,859,776

（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29年9月16日から平成29年11月10日まで、及び平成30年3月16日から平成30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29年11月10日 現在				平成30年5月10日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	284,363,688	-	283,026,088	1,337,600	1,086,592,997	-	1,089,873,680	3,280,683
アメリカ・ドル	228,077,600	-	226,740,000	1,337,600	821,248,528	-	824,151,252	2,902,724
イギリス・ポンド	-	-	-	-	8,451,849	-	8,451,282	567
シンガポール・ドル	-	-	-	-	256,892,620	-	257,271,146	378,526
ユーロ	56,286,088	-	56,286,088	0	-	-	-	-
買 建	56,286,088	-	56,256,562	29,526	757,006,997	-	758,743,207	1,736,210
アメリカ・ドル	56,286,088	-	56,256,562	29,526	265,344,469	-	267,069,327	1,724,858
シンガポール・ドル	-	-	-	-	491,662,528	-	491,673,880	11,352
合計	340,649,776	-	339,282,650	1,308,074	1,843,599,994	-	1,848,616,887	1,544,473

（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29年11月10日現在	平成30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)	2.2577円 (22,577円)	2.2182円 (22,182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	204,291	7,638,440.490	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	102,893	16,456,706.420	
		BOSTON PROPERTIES INC	170,119	21,137,285.750	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	268,099	11,051,040.780	
		GGP INC	546,165	11,087,149.500	
		EQUITY RESIDENTIAL	146,324	9,154,029.440	
		EPR PROPERTIES	141,740	8,456,208.400	
		EQUINIX INC	17,691	6,867,115.470	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	288,006	6,644,298.420	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	711,192	14,657,667.120	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	280,446	9,753,911.880	
		RLJ LODGING TRUST	338,620	7,287,102.400	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	978,661	14,934,366.860	
		CYRUSONE INC	138,315	7,473,159.450	
		HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	239,038	6,219,768.760	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	181,801	5,499,480.250	
		INVITATION HOMES INC	411,570	9,766,556.100	
		AMERICOLD REALTY TRUST	222,696	4,785,737.040	
		VICI PROPERTIES INC	456,133	8,616,352.370	
		VENTAS INC	36,466	1,938,167.900	
		GEO GROUP INC/THE	216,386	5,149,986.800	
		CROWN CASTLE INTL CORP	212,881	22,094,918.990	
		SUN COMMUNITIES INC	204,736	19,259,515.520	
		PROLOGIS INC	238,220	15,536,708.400	
		COUSINS PROPERTIES INC	1,021,356	9,386,261.640	
		DDR CORP	786,137	5,896,027.500	
		DUKE REALTY CORP	447,346	12,838,830.200	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	67,477	16,457,640.300	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	56,752	6,731,354.720	
		WELLTOWER INC	31,987	1,771,440.060	
		KILROY REALTY CORP	258,692	19,140,621.080	
		REGENCY CENTERS CORP	176,553	10,354,833.450	
		UDR INC	650,299	23,670,883.600	
		OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	178,769	5,069,888.840	
		CUBESMART	301,985	9,207,522.650	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	572,450	9,508,394.500	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	240,579	25,482,127.680	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	154,811	14,600,225.410	
		EDUCATION REALTY TRUST INC	267,549	9,190,308.150	
		DOUGLAS EMMETT INC	281,759	10,844,903.910	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 441,616,938.200	

			(48,560,198,525)
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド
	ASSURA PLC	18,662,035	11,197,221.000
	LAND SECURITIES GROUP PLC	1,004,282	9,858,032.110
	SEGRO PLC	2,586,779	16,715,765.890
	UNITE GROUP PLC	714,911	6,051,721.610
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	747,602	5,263,865.680
	DERWENT LONDON PLC	190,992	5,972,319.840
	WORKSPACE GROUP PLC	276,442	3,074,035.040
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	1,144,499	6,283,299.510
	BIG YELLOW GROUP PLC	726,191	7,094,886.070
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	4,174,980	8,124,511.080
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	3,968,230	5,972,186.150
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 85,607,843.980 (12,747,007,968)
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	NATIONAL STORAGE REIT	13,294,696	21,337,987.080
	DEXUS	3,914,079	38,357,974.200
	GPT GROUP	6,058,482	29,989,485.900
	INVESTA OFFICE FUND	3,950,536	17,500,874.480
	GOODMAN GROUP	4,373,324	40,147,114.320
	CHARTER HALL GROUP	2,828,442	17,677,762.500
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	7,421,624	20,038,384.800
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 185,049,583.280 (15,181,467,813)
カナダ・ドル			カナダ・ドル
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	317,793	14,799,620.010
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	477,098	20,505,672.040
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 35,305,292.050 (3,021,779,946)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	KEPPEL DC REIT	10,569,513	14,797,318.200
	KEPPEL DC REIT	4,434,400	5,999,743.200
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	771,800	2,045,270.000
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	5,052,800	13,844,672.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 36,687,003.400 (2,992,558,867)
ユーロ			ユーロ
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	728,411	9,134,273.940
	GECINA SA	148,840	21,522,264.000
	KLEPIERRE	435,500	14,968,135.000
	FONCIERE DES REGIONS	194,386	18,486,108.600
	AEDIFICA	62,403	4,886,154.900
	BENI STABILI SPA	1,225,468	956,477.770
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	905,093	9,168,592.090
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	1,458,817	18,818,739.300
ユーロ 小計			ユーロ 97,940,745.600 (12,754,823,299)
香港・ドル			香港・ドル
	FORTUNE REIT	13,505,070	124,246,644.000
	LINK REIT	2,769,920	185,584,640.000
香港・ドル 小計			香港・ドル 309,831,284.000

		(4,340,736,289)	
投資証券	合計	99,598,572,707	[99,598,572,707]
合計		99,598,572,707	[99,598,572,707]

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 40銘柄	100%	48.8%
イギリス・ポンド	投資証券 11銘柄	100%	12.8%
オーストラリア・ドル	投資証券 7銘柄	100%	15.2%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	100%	3.0%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	3.0%
ユーロ	投資証券 8銘柄	100%	12.8%
香港・ドル	投資証券 2銘柄	100%	4.4%

第2 信用取引契約残高明細表
 該当事項はありません。

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

[次へ](#)

「ダイワ」-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29年11月10日現在	平成30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	2,623,665,414	233,561,513
投資証券	82,429,778,300	99,152,114,210
未収入金	71,005,426	284,386,491
未収配当金	826,513,074	957,774,291
流動資産合計	85,950,962,214	100,627,836,505
資産合計	85,950,962,214	100,627,836,505
負債の部		
流動負債		
未払金	205,439,866	172,582,514
未払解約金	10,745,000	51,880,000
その他未払費用	-	9,577
流動負債合計	216,184,866	224,472,091
負債合計	216,184,866	224,472,091
純資産の部		
元本等		
元本	1 38,617,427,276	40,959,538,988
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	47,117,350,072	59,443,825,426
元本等合計	85,734,777,348	100,403,364,414
純資産合計	85,734,777,348	100,403,364,414
負債純資産合計	85,950,962,214	100,627,836,505

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29年11月11日 至 平成30年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
1. 1 期首	平成29年5月11日	平成29年11月11日

期首元本額	34,318,648,308円	38,617,427,276円
期中追加設定元本額	4,844,014,638円	3,337,346,221円
期中一部解約元本額	545,235,670円	995,234,509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)	22,432,943円	19,497,515円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	20,660,182円	18,104,325円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	105,047,483円	94,524,568円
6資産バランスファンド(分配型)	182,305,835円	156,326,786円
6資産バランスファンド(成長型)	384,008,698円	348,331,854円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	56,815,849円	49,732,466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	2,168,207円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	66,042,040円	56,400,862円
成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-07	27,499,017円	24,440,945円
成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-08	36,858,715円	29,605,887円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	200,558,243円	198,906,042円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	268,488,315円	268,247,027円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	331,022,645円	331,515,561円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	387,539,732円	359,168,025円
ダイワファンドラップJ-REITセレクト	35,413,355,208円	37,969,917,345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)	144,044,038円	124,539,025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)	46,221,969円	41,575,161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)	235,860,350円	197,588,628円
ダイワ・アクティブJリート・ファンド(年4回決算型)	686,162,007円	668,948,759円
計	38,617,427,276円	40,959,538,988円
2. 期末日における受益権の総数	38,617,427,276口	40,959,538,988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29年11月11日 至 平成30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30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29年11月10日現在	平成30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	7,558,532,420	6,331,933,100
合計	7,558,532,420	6,331,933,100

(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29年5月11日から平成29年11月10日まで、及び平成29年11月11日から平成30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29年11月10日現在	平成30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29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
1口当たり純資産額	2.2201円	2.4513円
(1万口当たり純資産額)	(22,201円)	(24,513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	3,179	1,529,099,000	
	MCUBS MidCity投資法人	20,805	1,726,815,000	
	森ヒルズリート	21,092	2,954,989,200	
	産業ファンド	11,558	1,400,829,600	
	アドバンス・レジデンス	8,480	2,399,840,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	8,158	1,308,543,200	
	API投資法人	6,914	3,356,747,000	
	GLP投資法人	15,814	1,870,796,200	
	コンフォリア・レジデンシャル	5,510	1,387,418,000	
	日本プロロジスリート	20,899	4,829,758,900	
	星野リゾート・リート	1,059	569,742,000	
	ONEリート投資法人	613	151,349,700	
	イオンリート投資	16,519	1,927,767,300	
	ヒューリックリート投資法	11,798	1,967,906,400	
	日本リート投資法人	5,982	1,986,024,000	
	インベスコ・オフィス・Jリート	111,194	1,544,484,660	
	積水ハウス・リート投資	31,843.1	2,213,095,450	
	ケネディクス商業リート	7,264	1,674,352,000	
	ヘルスケア&メディカル投資	1,783	190,424,400	
	野村不動産マスターF	42,942	6,634,539,000	
	ラサールロジポート投資	15,782	1,751,802,000	
	三井不ロジパーク	100	34,950,000	
	大江戸温泉リート	9,864	897,624,000	
	投資法人みらい	5,300	970,960,000	
	森トラスト・ホテルリート投	1,029	149,205,000	
	三菱地所物流REIT	3,908	1,061,022,000	
	CREロジスティクスファンド	3,835	441,792,000	
	ザイマックス・リート	7,508	873,931,200	
	日本ビルファンド	7,943	4,940,546,000	
	ジャパンリアルエステイト	14,450	8,207,600,000	
	日本リテールファンド	15,272	3,142,977,600	
	オリックス不動産投資	21,199	3,637,748,400	
	日本プライムリアルティ	7,129	2,880,116,000	
	プレミア投資法人	11,573	1,249,884,000	
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,196	237,168,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	16,960	2,927,296,000	
	森トラスト総合リート	7,939	1,285,324,100	
	インヴィンシブル投資法人	41,337	2,066,850,000	
	フロンティア不動産投資	5,493	2,485,582,500	
	平和不動産リート	9,724	1,052,136,800	
	日本ロジスティクスファンド投資法人	751	168,975,000	
	福岡リート投資法人	5,527	950,644,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	3,446	2,305,374,000	
いちごオフィスリート投資法人	10,840	904,056,000		
大和証券オフィス投資法人	2,580	1,627,980,000		
阪急リート投資法人	1,068	149,733,600		
スターツプロシード投資法人	3,586	586,669,600		
大和ハウスリート投資法人	16,777	4,388,863,200		
ジャパン・ホテル・リート投資法人	39,681	3,226,065,300		
日本賃貸住宅投資法人	18,497	1,585,192,900		
ジャパンエクセレント投資法人	9,420	1,339,524,000		

投資証券 合計		99,152,114,210	
合計		99,152,114,210	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	32,530,439	36,467,755
コール・ローン	38,649,103	68,153,131
株式	1,513,676,424	1,601,628,375
ハイブリッド優先証券	446,677,564	422,859,171
投資証券	41,079,866	46,958,472
未収入金	66,509,186	5,727,624
未収配当金	1,889,764	1,936,535
未収利息	952,798	870,079
流動資産合計	2,141,965,144	2,184,601,142
資産合計	2,141,965,144	2,184,601,142
負債の部		
流動負債		
未払金	35,615,998	6,427,480
未払解約金	2,000,000	48,000
その他未払費用	-	726
流動負債合計	37,615,998	6,476,206
負債合計	37,615,998	6,476,206
純資産の部		
元本等		
元本	1 835,013,823	871,352,002
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,269,335,323	1,306,772,934
元本等合計	2,104,349,146	2,178,124,936
純資産合計	2,104,349,146	2,178,124,936
負債純資産合計	2,141,965,144	2,184,601,142

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29年11月11日 至 平成30年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <p>(2)ハイブリッド優先証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(3)投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>(1)受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p> <p>(2)受取利息</p> <p>ハイブリッド優先証券の受取利息については、当該証券の権利落ち日において、確定している金額を計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分		平成29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
1.	1 期首	平成29年5月11日	平成29年11月11日
	期首元本額	891,301,312円	835,013,823円
	期中追加設定元本額	45,327,010円	62,797,186円
	期中一部解約元本額	101,614,499円	26,459,007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）	13,132,996円	12,748,365円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	12,337,501円	11,555,045円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	231,442,799円	216,924,047円
ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	38,937,509円	37,006,944円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	39,850,271円	36,749,126円
米国好配当株オープン（予想分配金提示型）	441,935円	416,476円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	81,111,597円	90,405,911円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	163,687,221円	182,754,162円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	254,071,994円	282,791,926円
計	835,013,823円	871,352,002円
2. 期末日における受益権の総数	835,013,823口	871,352,002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29年11月11日 至 平成30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30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29年11月10日現在	平成30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	13,758,382	9,009,833
ハイブリッド優先証券	673,844	1,976,619
投資証券	223,552	271,659
合計	13,308,090	6,761,555

（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29年10月17日から平成29年11月10日まで、及び平成30年4月17日から平成30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29年11月10日現在	平成30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29年11月10日現在	平成30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)	2.5201円 (25,201円)	2.4997円 (24,997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	2,802	59.400	166,438.800	
	AETNA INC	1,132	170.570	193,085.240	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	618	164.890	101,902.020	
	TE CONNECTIVITY LTD	2,435	93.460	227,575.100	
	APPLE INC	1,742	187.360	326,381.120	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,500	46.380	162,330.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	3,166	113.410	359,056.060	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	841	134.240	112,895.840	
	FIRST AMERICAN FINANCIAL	2,297	53.190	122,177.430	
	CISCO SYSTEMS INC	5,181	46.040	238,533.240	
	MORGAN STANLEY	3,905	54.140	211,416.700	
	TIME WARNER INC	3,302	92.380	305,038.760	
	TELEFLEX INC	267	267.090	71,313.030	
	COLGATE-PALMOLIVE CO	3,432	61.910	212,475.120	
	EXXON MOBIL CORP	2,532	79.930	202,382.760	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	1,015	84.720	85,990.800	
	NEXTERA ENERGY INC	929	158.290	147,051.410	
	GENERAL DYNAMICS CORP	655	201.050	131,687.750	
	ALPHABET INC-CL A	575	1,088.950	626,146.250	
FIRSTENERGY CORP	4,118	33.520	138,035.360		
HALLIBURTON CO	4,682	52.700	246,741.400		
HOME DEPOT INC	896	186.360	166,978.560		

ASSURANT INC	2,017	86.390	174,248.630	
TRINSEO SA	1,890	75.500	142,695.000	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,789	142.610	255,129.290	
INTERNATIONAL PAPER CO	2,200	52.190	114,818.000	
JOHNSON & JOHNSON	2,000	123.510	247,020.000	
LAM RESEARCH CORP	828	199.720	165,368.160	
FACEBOOK INC-A	2,613	182.660	477,290.580	
MYLAN NV	4,325	36.720	158,814.000	
BAKER HUGHES A GE CO	1,911	36.370	69,503.070	
MERCK & CO. INC.	1,217	57.950	70,525.150	
DOWDUPONT INC	1,927	66.030	127,239.810	
NORTHROP GRUMMAN CORP	500	327.590	163,795.000	
APTIV PLC	1,420	94.390	134,033.800	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	2,864	82.400	235,993.600	
XCEL ENERGY INC	2,894	44.810	129,680.140	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	566	201.520	114,060.320	
PROCTER & GAMBLE CO/THE	3,084	72.370	223,189.080	
ACCENTURE PLC-CL A	1,214	154.620	187,708.680	
QUALCOMM INC	3,549	53.170	188,700.330	
REGIONS FINANCIAL CORP	7,542	19.220	144,957.240	
SCHLUMBERGER LTD	2,712	70.880	192,226.560	
AT&T INC	5,936	31.400	186,390.400	
UNION PACIFIC CORP	1,038	139.900	145,216.200	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	2,529	111.400	281,730.600	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1,781	117.270	208,857.870	
ANTHEM INC	755	221.770	167,436.350	
WALT DISNEY CO/THE	2,000	99.970	199,940.000	
WALMART INC	3,565	83.060	296,108.900	
TJX COMPANIES INC	2,734	83.890	229,355.260	
VISA INC-CLASS A SHARES	1,411	130.840	184,615.240	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	830	150.290	124,740.700	
ORACLE CORP	6,541	46.580	304,679.780	
BANK OF AMERICA CORP	14,229	30.720	437,114.880	
ANALOG DEVICES INC	1,570	92.620	145,413.400	
ALASKA AIR GROUP INC	2,200	60.390	132,858.000	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,319	52.820	175,309.580	
ANADARKO PETROLEUM CORP	1,106	67.440	74,588.640	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2,184	105.170	229,691.280	
EATON CORP PLC	2,690	75.660	203,525.400	
SNAP-ON INC	1,200	148.040	177,648.000	
MICROSOFT CORP	6,125	96.940	593,757.500	
MEDTRONIC PLC	2,702	84.060	227,130.120	
CHUBB LTD	1,928	134.690	259,682.320	
ZIONS BANCORPORATION	2,858	57.280	163,706.240	
BIOGEN INC	777	274.030	212,921.310	
STARBUCKS CORP	4,700	57.040	268,088.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 13,903,135.160 (1,528,788,742)	
カナダ・ドル	株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
SUNCOR ENERGY INC	4,600	50.180	230,828.000	
BANK OF NOVA SCOTIA	2,000	80.000	160,000.000	
ROYAL BANK OF CANADA	1,617	99.630	161,101.710	
MAGNA INTERNATIONAL INC	2,500	78.160	195,400.000	
ENBRIDGE INC	2,500	41.480	103,700.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 851,029.710 (72,839,633)	
合計			1,601,628,375 [1,601,628,375]	

(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	4,450.000	115,032.500	
		CHS INC 7.5 4	5,000.000	137,350.000	
		JPMORGAN CHASE & CO 6.1 AA	5,225.000	135,693.250	
		CHARLES SCHWAB CORP 6 C	1,075.000	28,079.000	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.2 F	1,100.000	28,710.000	
		SCE TRUST IV 5.375 J	1,267.000	32,181.800	
		SOUTHERN CO 6.25	2,254.000	58,446.220	
		AMERICAN FINANCIAL GROUP 6	3,775.000	95,696.250	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.7 W	1,854.000	46,312.920	
		BANK OF AMERICA CORP 6.2 CC	1,147.000	29,454.960	
		CITIGROUP INC 6.3 S	7,300.000	189,143.000	
		GOLDMAN SACHS GROUP INC 6.3 N	723.000	18,870.300	
		EBAY INC 6	666.000	17,422.560	
		BERKLEY (WR) CORPORATION 5.9	2,675.000	66,607.500	
		SCE TRUST V 5.45 K	1,150.000	29,014.500	
		BANK OF AMERICA CORP 6 EE	3,056.000	77,408.480	
		BERKLEY (WR) CORPORATION 5.75	4,411.000	108,819.370	
		VALIDUS HOLDINGS LTD 5.875 A	3,400.000	86,649.000	
		STIFEL FINANCIAL CORP 6.25 A	723.000	18,971.520	
		LEGG MASON INC 5.45	4,300.000	103,501.000	
		ENTERGY LOUISIANA LLC 4.875 *	1,200.000	29,088.000	
		ARCH CAPITAL GROUP LTD 5.25 E	1,200.000	28,440.000	
		MORGAN STANLEY 5.85 K	1,476.000	38,007.000	
		DTE ENERGY CO 6 F	2,600.000	67,782.000	
		NY COMMUNITY BANCORP INC 6.375 A.	603.000	16,250.850	
		SCE TRUST VI 5	4,481.000	101,046.550	
		VALLEY NATIONAL BANCORP 5.5 B	2,601.000	67,105.800	
		TCF FINANCIAL CO 5.7 C	1,975.000	48,920.750	
		SOUTHERN CO 5.25	986.000	23,841.480	
		ENBRIDGE INC FR B	3,775.000	95,281.000	
		BANK OF AMERICA CORP 6 GG	2,000.000	50,040.000	
		GENERAL ELECTRIC CO 4.7	2,725.000	68,928.870	
		BANK OF AMERICA CORP 6.5 Y	4,375.000	113,837.500	
		REGIONS FINANCIAL CORP 6.375 A	2,650.000	67,919.500	
		HANOVER INSURANCE GROUP 6.35	2,100.000	53,025.000	
		CITIGROUP INC 6.875 K	835.000	22,586.750	
		WELLS FARGO & COMPANY 6 T	7,000.000	178,780.000	
		WELLS FARGO & COMPANY 8 J	1,543.000	39,917.410	
		CITIGROUP CAPITAL XIII 8.72866	2,275.000	60,219.250	
		PARTNERRE LTD 6.5 G	1,076.000	28,298.800	
		MORGAN STANLEY 6.875 F	3,116.000	85,939.280	
		ALLY FINANCIAL 7.62375 2/15/40	4,350.000	114,144.000	
		US BANCORP 6.5 F	1,000.000	27,720.000	
		BB&T CORPORATION 5.85	3,601.000	91,969.540	
		BB&T CORPORATION 5.625 E	2,897.000	72,946.460	
		MORGAN STANLEY 6.375 I	3,325.000	88,844.000	
		NUSTAR LOGISTICS LP FR	6,175.000	155,610.000	
		REINSURANCE GRP OF AMER 6.2	5,618.000	150,281.500	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6 B	1,875.000	47,568.750	
		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.25 C	2,000.000	51,580.000	
		STATE STREET CORP 5.9 D	5,475.000	145,197.000	
		WELLS FARGO & COMPANY 5.85 Q	863.000	22,368.960	
		CITIGROUP INC 7.125 J	638.000	17,755.540	

		CAPITAL ONE FINANCIAL CO 6.7 D	2,100.000	55,587.000	
		PPL CAPITAL FUNDING INC 5.9 B	3,800.000	95,380.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 3,845,572.670 (422,859,171)	
ハイブリッド優先証券 合計				422,859,171 [422,859,171]	
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		SUNSTONE HOTEL INVESTORS 6.95 E	793	19,928.090	
		AMERICAN HOMES 4 RENT 6.35 E	1,750	43,645.000	
		MONMOUTH REIT 6.125 C	1,975	47,103.750	
		NATIONAL RETAIL PROP INC 5.2 F	597	13,844.430	
		COLONY NORTHSTAR INC 8.75 E	2,150	53,900.500	
		COLONY NORTHSTAR INC 7.15 I	700	15,939.000	
		GLOBAL NET LEASE INC 7.25 A	1,100	27,115.000	
		NATIONAL STORAGE AFFILIA 6 A	2,550	60,307.500	
		QTS REALTY TRUST INC 7.125 A	1,175	29,657.000	
		NATIONAL RETAIL PROP INC 5.7 E	1,058	25,487.220	
		GRAMERCY PROPERTY TRUST 7.125 A	1,700	43,588.000	
		DDR CORP 6.5 J	2,050	46,535.000	
	アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 427,050.490 (46,958,472)	
投資証券 合計				46,958,472 [46,958,472]	
合計				469,817,643 [469,817,643]	

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	68銘柄	76.5%	21.2%	2.3%	
	ハイブリッド優先証券	55銘柄				
	投資証券	12銘柄				
カナダ・ドル	株式	5銘柄	100%	-%	-%	3.5%

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	43,815,912	46,301,462
コール・ローン	17,287,594	13,751,261
株式	1,258,981,570	1,241,875,960
未収配当金	1,600,344	4,278,428
流動資産合計	1,321,685,420	1,306,207,111
資産合計	1,321,685,420	1,306,207,111
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,128,000	1,000,000
その他未払費用	-	326
流動負債合計	1,128,000	1,000,326
負債合計	1,128,000	1,000,326
純資産の部		
元本等		
元本	1 779,132,028	775,897,011
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	541,425,392	529,309,774
元本等合計	1,320,557,420	1,305,206,785
純資産合計	1,320,557,420	1,305,206,785
負債純資産合計	1,321,685,420	1,306,207,111

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29年11月11日 至 平成30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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。

3. 収益及び費用の計上基準	<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29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
1.	1 期首	平成29年5月11日	平成29年11月11日
	期首元本額	844,063,336円	779,132,028円
	期中追加設定元本額	36,815,799円	33,382,269円
	期中一部解約元本額	101,747,107円	36,617,286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）	19,410,399円	18,843,762円
	インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	18,001,569円	16,824,713円
	成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	339,434,515円	320,562,608円
	ダイワ・株／債券／コモディティ・バランスファンド	57,747,427円	57,165,219円
	ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	58,800,323円	54,170,146円
	DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	46,411,585円	50,337,608円
	DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	93,838,955円	101,386,247円
	DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	145,487,255円	156,606,708円
	計	779,132,028円	775,897,011円
2.	期末日における受益権の総数	779,132,028口	775,897,011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29年11月11日 至 平成30年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>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。</p>

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30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29年11月10日現在	平成30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	3,710,379	50,893,960
合計	3,710,379	50,893,960

(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29年10月17日から平成29年11月10日まで、及び平成30年4月17日から平成30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29年11月10日現在	平成30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29年11月10日現在	平成30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)	1.6949円 (16,949円)	1.6822円 (16,822円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	

イギリス・ボンド		株	イギリス・ボンド	イギリス・ボンド	
	PRUDENTIAL PLC	14,844	19.345	287,157.180	
	AVIVA PLC	40,669	5.406	219,856.610	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	15,900	14.786	235,097.400	
	VODAFONE GROUP PLC	96,642	2.087	201,691.850	
	KINGFISHER PLC	30,751	2.883	88,655.130	
	NATIONAL GRID PLC	10,672	8.443	90,103.690	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,047	39.090	197,287.230	
	HSBC HOLDINGS PLC	43,404	7.195	312,291.780	
	CARNIVAL PLC	3,111	47.970	149,234.670	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	11,761	26.335	309,725.930	
イギリス・ボンド 小計				イギリス・ボンド 2,091,101.470 (311,365,009)	
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	226.000	232,554.000	
	NESTLE SA-REG	5,858	77.400	453,409.200	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,034	318.300	329,122.200	
	NOVARTIS AG-REG	4,389	77.700	341,025.300	
	GIVAUDAN-REG	138	2,266.000	312,708.000	
スイス・フラン 小計				スイス・フラン 1,668,818.700 (182,468,637)	
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	13,623	90.640	1,234,788.720	
	SWEDBANK AB - A SHARES	5,994	195.700	1,173,025.800	
スウェーデン・クローナ 小計				スウェーデン・クローナ 2,407,814.520 (30,386,619)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	SIEMENS AG-REG	2,800	114.600	320,880.000	
	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	2,996	91.960	275,512.160	
	BASF SE	3,218	86.140	277,198.520	
	ALLIANZ SE-REG	1,074	198.540	213,231.960	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,239	192.500	238,507.500	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	21,145	14.300	302,373.500	
	KONINKLIJKE PHILIPS NV	8,394	35.270	296,056.380	
	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	6,506	19.376	126,060.250	
	KONINKLIJKE DSM NV	3,798	85.600	325,108.800	
	KONINKLIJKE KPN NV	87,929	2.596	228,263.680	
	ABN AMRO GROUP NV-CVA	6,169	25.940	160,023.860	
	TOTAL SA	6,299	52.780	332,461.220	
	SCHNEIDER ELECTRIC SE	4,676	75.220	351,728.720	
	BNP PARIBAS	3,990	62.650	249,973.500	
	CASINO GUICHARD PERRACHON	3,870	41.870	162,036.900	
	CAPGEMINI SE	1,406	115.400	162,252.400	
	ALSTOM	4,147	38.590	160,032.730	
	SANOFI	3,682	66.260	243,969.320	
	INTESA SANPAOLO	68,243	3.160	215,647.880	
	ENI SPA	14,849	16.686	247,770.410	
	ENEL SPA	48,153	5.240	252,321.720	
	ENAGAS SA	10,115	24.390	246,704.850	
	NOKIA OYJ	23,125	5.300	122,562.500	
ユーロ 小計				ユーロ 5,510,678.760 (717,655,695)	
合計				1,241,875,960 [1,241,875,960]	

- (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 10銘柄	100%	25.1%
スイス・フラン	株式 5銘柄	100%	14.7%
スウェーデン・クローナ	株式 2銘柄	100%	2.4%
ユーロ	株式 23銘柄	100%	57.8%

- 第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

[次へ](#)

「ダイワ・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29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	22,639,503	11,315,907
コール・ローン	10,005,538	8,061,488
株式	910,406,358	841,080,871
投資証券	7,650,857	-
未収入金	25,754,281	-
未収配当金	759,515	1,471,842
流動資産合計	977,216,052	861,930,108
資産合計	977,216,052	861,930,108
負債の部		
流動負債		
未払金	22,583,288	-
未払解約金	6,208,000	-
その他未払費用	-	50
流動負債合計	28,791,288	50
負債合計	28,791,288	50
純資産の部		
元本等		
元本	1 406,151,611	379,998,187
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	542,273,153	481,931,871
元本等合計	948,424,764	861,930,058
純資産合計	948,424,764	861,930,058
負債純資産合計	977,216,052	861,930,108

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29年11月11日 至 平成30年5月10日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)投資証券</p>

	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分		平成29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
1.	1 期首	平成29年5月11日	平成29年11月11日
	期首元本額	470,828,997円	406,151,611円
	期中追加設定元本額	5,330,707円	6,586,643円
	期中一部解約元本額	70,008,093円	32,740,067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）	14,509,082円	13,647,901円
	インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	13,271,684円	12,431,375円
	成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	253,875,811円	233,357,045円
	ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	42,629,569円	39,116,871円
	ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	43,444,227円	39,121,609円
	DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	6,241,392円	6,888,201円

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 6分散コース）	12,611,636円	13,920,813円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽 / 成長コース）	19,568,210円	21,514,372円
計	406,151,611円	379,998,187円
2. 期末日における受益権の総数	406,151,611口	379,998,187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29年11月11日 至 平成30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30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29年11月10日現在	平成30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	29,550,088	16,157,393
投資証券	548,667	-
合計	30,098,755	16,157,393

（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29年10月17日から平成29年11月10日まで、及び平成30年4月17日から平成30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29年11月10日現在	平成30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29年11月10日現在	平成30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)	2.3351円 (23,351円)	2.2682円 (22,682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	
	AUTOHOME INC-ADR	1,000	99.670	99,670.000	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	1,000	91.990	91,990.000	
	WEIBO CORP-SPON ADR	700	109.820	76,874.000	
アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 268,534.000 (29,527,999)	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	BHP BILLITON LIMITED	7,100	32.190	228,549.000	
	ALUMINA LTD	82,000	2.790	228,780.000	
	OZ MINERALS LTD	11,700	10.070	117,819.000	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	7,400	28.720	212,528.000	
	WESTPAC BANKING CORP	9,200	29.750	273,700.000	
	RIO TINTO LTD	1,400	81.670	114,338.000	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	4,200	71.410	299,922.000	
	QANTAS AIRWAYS LTD	41,000	6.320	259,120.000	
	MACQUARIE GROUP LTD	2,000	112.870	225,740.000	
	CSL LTD	700	173.240	121,268.000	
	COCHLEAR LTD	600	194.220	116,532.000	
SUNCORP GROUP LTD	7,900	14.050	110,995.000		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,500	65.330	97,995.000		
オーストラリア・ドル	小計			オーストラリア・ドル 2,407,286.000 (197,493,744)	
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	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	8,100	29.280	237,168.000	
	APAC REALTY LTD	174,100	1.030	179,323.000	
	GENTING SINGAPORE PLC	163,600	1.160	189,776.000	
シンガポール・ドル	小計			シンガポール・ドル 606,267.000 (49,453,200)	
韓国・ウォン		株	韓国・ウォン	韓国・ウォン	
	POSCO	470	350,500.000	164,735,000.000	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	440	398,000.000	175,120,000.000	
	S-OIL CORP	700	106,000.000	74,200,000.000	
	KIWOOM SECURITIES CO LTD	1,500	116,000.000	174,000,000.000	
	POSCO DAEWOO CORP	5,544	22,050.000	122,245,200.000	
	KB FINANCIAL GROUP INC	1,400	58,200.000	81,480,000.000	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	11,750	50,900.000	598,075,000.000	
	MODETOUR NETWORK INC	6,500	33,400.000	217,100,000.000	
SK INNOVATION CO LTD	400	202,000.000	80,800,000.000		

韓国・ウォン 小計				韓国・ウォン 1,687,755,200.000 (172,319,806)
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	21,000	67.900	1,425,900.000
	CHINA GAS HOLDINGS LTD	54,000	29.050	1,568,700.000
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	156,000	7.880	1,229,280.000
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,600	257.000	668,200.000
	TENCENT HOLDINGS LTD	3,100	394.600	1,223,260.000
	3SBIO INC	47,000	18.800	883,600.000
	AIA GROUP LTD	10,400	69.700	724,880.000
	WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	18,500	76.150	1,408,775.000
	TIMES CHINA HOLDINGS LTD	99,000	11.560	1,144,440.000
	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	11,500	76.950	884,925.000
	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	80,000	16.160	1,292,800.000
	AVICHINA INDUSTRY & TECH-H	172,000	4.870	837,640.000
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	16,500	40.750	672,375.000
	AGILE GROUP HOLDINGS LTD	40,000	15.760	630,400.000
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	210,000	5.490	1,152,900.000	
WYNN MACAU LTD	36,000	29.900	1,076,400.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 16,824,475.000 (235,710,894)
台湾・ドル		株	台湾・ドル	台湾・ドル
	TAIMED BIOLOGICS INC	7,000	316.000	2,212,000.000
	MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	23,000	100.000	2,300,000.000
	CHROMA ATE INC	12,000	158.500	1,902,000.000
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	7,000	503.000	3,521,000.000
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	12,000	447.500	5,370,000.000
	GOURMET MASTER CO LTD	7,100	353.500	2,509,850.000
	CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	92,000	53.600	4,931,200.000
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	86,000	75.000	6,450,000.000
	E INK HOLDINGS INC	100,000	31.400	3,140,000.000
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	45,000	229.500	10,327,500.000	
台湾・ドル 小計				台湾・ドル 42,663,550.000 (156,575,228)
合計				841,080,871 [841,080,871]

- (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
アメリカ・ドル	株式 3銘柄	100%	3.5%
オーストラリア・ドル	株式 13銘柄	100%	23.5%
シンガポール・ドル	株式 3銘柄	100%	5.9%
韓国・ウォン	株式 9銘柄	100%	20.5%
香港・ドル	株式 16銘柄	100%	28.0%
台湾・ドル	株式 10銘柄	100%	18.6%

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。

[次へ](#)

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

貸借対照表

	平成29年11月10日現在	平成30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	977,950,244	949,932,501
株式	20,098,486,830	19,770,643,000
派生商品評価勘定	35,258,800	35,578,400
未収入金	541,162,083	179,033,933
未収配当金	217,462,450	239,912,000
差入委託証拠金	13,950,000	18,000,000
流動資産合計	21,884,270,407	21,193,099,834
資産合計	21,884,270,407	21,193,099,834
負債の部		
流動負債		
前受金	42,175,000	33,600,000
未払金	188,507,126	287,390,520
未払解約金	63,691,000	77,000
その他未払費用	-	11,275
流動負債合計	294,373,126	321,078,795
負債合計	294,373,126	321,078,795
純資産の部		
元本等		
元本	1 7,074,251,203	6,859,070,735
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	14,515,646,078	14,012,950,304
元本等合計	21,589,897,281	20,872,021,039
純資産合計	21,589,897,281	20,872,021,039
負債純資産合計	21,884,270,407	21,193,099,834

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29年11月11日 至 平成30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、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	先物取引

3. 収益及び費用の計上基準	<p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>受取配当金 原則として、株式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29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	平成29年5月11日 13,526,788,046円 251,791,782円 6,704,328,625円	平成29年11月11日 7,074,251,203円 469,789,613円 684,970,081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（季節点描）	5,580,722,518円	5,400,022,642円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	31,237,434円	28,052,281円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	34,162,122円	31,641,606円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	31,001,027円	28,740,608円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	585,119,445円	533,448,022円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	98,468,829円	90,006,369円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	100,112,241円	90,129,440円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	99,469,212円	107,079,393円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	201,054,588円	216,042,443円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	312,903,787円	333,907,931円
計	7,074,251,203円	6,859,070,735円
2. 期末日における受益権の総数	7,074,251,203口	6,859,070,735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29年11月11日 至 平成30年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成30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29年11月10日現在	平成30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	1,038,281,078	562,086,047
合計	1,038,281,078	562,086,047

（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29年10月17日から平成29年11月10日まで、及び平成30年4月17日から平成30年5月10日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

種 類	平成29年11月10日 現在				平成30年5月10日 現在			
	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち 1年超	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引								
株価指数 先物取引								
買 建	502,025,000	-	537,300,000	35,275,000	675,800,000	-	711,400,000	35,600,000

合計	502,025,000	-	537,300,000	35,275,000	675,800,000	-	711,400,000	35,600,000
----	-------------	---	-------------	------------	-------------	---	-------------	------------

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報)

	平成29年11月10日現在	平成30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)	3.0519円 (30,519円)	3.0430円 (30,430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	
熊谷組	45,000	3,680.00	165,600,000	
大和ハウス	145,000	4,071.00	590,295,000	
関電工	75,000	1,266.00	94,950,000	
ウェルネット	40,000	1,283.00	51,320,000	
双日	325,000	419.00	136,175,000	
日本たばこ産業	40,000	2,994.00	119,760,000	
アルコニックス	42,500	1,992.00	84,660,000	
J. フロント リテイリング	25,000	1,788.00	44,700,000	
ダイワボウHD	22,500	5,020.00	112,950,000	
三洋貿易	25,000	2,279.00	56,975,000	
セブン&アイ・HLDGS	37,500	4,762.00	178,575,000	
旭化成	100,000	1,518.50	151,850,000	
サカイ オーベックス	12,500	2,410.00	30,125,000	
SUMCO	30,000	2,847.00	85,410,000	
三菱総合研究所	7,500	4,405.00	33,037,500	
昭和電工	35,000	4,255.00	148,925,000	
住友化学	310,000	644.00	199,640,000	
クレハ	15,000	7,620.00	114,300,000	
東亜合成	40,000	1,224.00	48,960,000	
デンカ	25,000	4,195.00	104,875,000	
信越化学	16,000	11,270.00	180,320,000	
日本化学工業	10,000	3,275.00	32,750,000	
カネカ	105,000	1,085.00	113,925,000	
三井化学	20,000	3,160.00	63,200,000	
JSR	20,000	2,083.00	41,660,000	
三菱ケミカルHLDGS	195,000	1,039.00	202,605,000	
住友ベークライト	120,000	989.00	118,680,000	
宇部興産	27,500	3,330.00	91,575,000	
旭有機材	17,500	1,814.00	31,745,000	
日立化成	20,000	2,410.00	48,200,000	
ダイキアクシス	42,500	1,497.00	63,622,500	
電通	55,000	5,170.00	284,350,000	
扶桑化学工業	13,500	2,602.00	35,127,000	

花 王	15,000	7,663.00	114,945,000
三洋化成	4,000	5,320.00	21,280,000
武田薬品	42,500	4,621.00	196,392,500
アステラス製薬	97,500	1,655.50	161,411,250
大日本住友製薬	45,000	1,930.00	86,850,000
エーザイ	12,500	7,339.00	91,737,500
みらかホールディングス	2,500	4,180.00	10,450,000
沢井製薬	12,500	4,625.00	57,812,500
大塚ホールディングス	37,500	5,291.00	198,412,500
パーク24	10,000	3,100.00	31,000,000
トレンドマイクロ	14,000	6,500.00	91,000,000
構造計画研究所	15,000	2,595.00	38,925,000
日本ハウズイング	8,500	3,050.00	25,925,000
WOWOW	15,000	3,470.00	52,050,000
資 生 堂	2,000	7,201.00	14,402,000
ポーラ・オルビスHD	30,000	5,070.00	152,100,000
デクセリアルズ	30,000	1,104.00	33,120,000
出光興産	25,000	4,060.00	101,500,000
JXTGホールディングス	300,000	719.20	215,760,000
東洋ゴム	10,000	1,751.00	17,510,000
ブリヂストン	15,000	4,511.00	67,665,000
旭 硝 子	32,500	4,775.00	155,187,500
ノ ザ ワ	20,000	1,233.00	24,660,000
東海カーボン	115,000	1,729.00	198,835,000
フジインコーポレーテッド	32,500	2,325.00	75,562,500
ニチアス	35,000	1,463.00	51,205,000
JFEホールディングス	45,000	2,345.50	105,547,500
日立金属	35,000	1,322.00	46,270,000
大紀アルミニウム	80,000	741.00	59,280,000
日本軽金属HD	275,000	296.00	81,400,000
三井金属	5,000	4,840.00	24,200,000
東邦亜鉛	5,000	4,905.00	24,525,000
住友鋳山	80,000	4,701.00	376,080,000
住友電工	30,000	1,664.00	49,920,000
LIXILグループ	70,000	2,498.00	174,860,000
東 プ レ	25,000	3,395.00	84,875,000
東芝機械	135,000	622.00	83,970,000
アイダエンジニア	137,500	1,277.00	175,587,500
F U J I	17,500	1,844.00	32,270,000
旭ダイヤモンド	15,000	1,059.00	15,885,000
D M G 森精機	80,000	2,156.00	172,480,000
ディスコ	3,500	20,590.00	72,065,000
ソラスト	10,000	3,010.00	30,100,000
豊田自動織機	10,000	6,990.00	69,900,000
イワキポンプ	15,000	3,665.00	54,975,000
野村マイクロ・サイエンス	55,000	1,097.00	60,335,000
小松製作所	65,000	3,582.00	232,830,000
住友重機械	25,000	4,165.00	104,125,000
荏原実業	30,000	2,422.00	72,660,000
三精テクノロジーズ	25,000	1,451.00	36,275,000
キトー	60,000	2,133.00	127,980,000
ア マ ノ	10,000	2,790.00	27,900,000
ツバキ・ナカシマ	20,000	2,583.00	51,660,000
日本精工	85,000	1,427.00	121,295,000
三菱電機	140,000	1,634.00	228,760,000

日本電産	10,000	16,930.00	169,300,000
愛知電機	20,000	3,300.00	66,000,000
T D K	18,000	9,860.00	177,480,000
マクセルホールディングス	65,000	1,721.00	111,865,000
堀場製作所	12,000	9,310.00	111,720,000
デンソー	42,500	5,518.00	234,515,000
ローム	13,500	10,700.00	144,450,000
村田製作所	1,000	14,440.00	14,440,000
日産自動車	105,000	1,110.50	116,602,500
トヨタ自動車	65,000	7,592.00	493,480,000
日野自動車	95,000	1,279.00	121,505,000
三菱自動車工業	360,000	858.00	308,880,000
武蔵精密工業	10,000	4,170.00	41,700,000
アイシン精機	20,000	5,960.00	119,200,000
本田技研	75,000	3,550.00	266,250,000
S U B A R U	20,000	3,692.00	73,840,000
萩原電気H L D G S	17,500	3,105.00	54,337,500
東京精密	13,500	4,295.00	57,982,500
キヤノン	60,000	3,790.00	227,400,000
バンダイナムコH L D G S	29,000	4,095.00	118,755,000
桑山	25,400	595.00	15,113,000
任天堂	4,500	45,500.00	204,750,000
伊藤忠	275,000	2,033.50	559,212,500
三井物産	210,000	1,934.50	406,245,000
東京エレクトロン	10,000	21,245.00	212,450,000
日立ハイテクノロジーズ	10,000	5,050.00	50,500,000
住友商事	157,500	1,925.50	303,266,250
日本ユニシス	32,500	2,630.00	85,475,000
三菱商事	202,500	3,187.00	645,367,500
阪和興業	17,500	4,795.00	83,912,500
伊藤忠エネクス	60,000	1,091.00	65,460,000
あおぞら銀行	30,000	4,410.00	132,300,000
三菱UFJフィナンシャルG	850,000	719.00	611,150,000
りそなホールディングス	140,000	619.00	86,660,000
三井住友トラストHD	32,500	4,681.00	152,132,500
三井住友フィナンシャルG	157,500	4,492.00	707,490,000
みずほフィナンシャルG	1,450,000	198.10	287,245,000
S B Iホールディングス	40,000	2,908.00	116,320,000
日立キャピタル	25,000	2,955.00	73,875,000
オリックス	120,000	1,950.50	234,060,000
野村ホールディングス	190,000	610.00	115,900,000
いちよし証券	60,000	1,288.00	77,280,000
S O M P Oホールディングス	45,000	4,690.00	211,050,000
M S & A D	60,000	3,699.00	221,940,000
第一生命H L D G S	67,500	2,133.00	143,977,500
東京海上HD	55,000	5,249.00	288,695,000
T & Dホールディングス	60,000	1,809.50	108,570,000
三井不動産	40,000	2,789.50	111,580,000
住友不動産	10,000	4,402.00	44,020,000
サンフロンティア不動産	30,000	1,447.00	43,410,000
西日本旅客鉄道	16,000	8,011.00	128,176,000
S Gホールディングス	35,000	2,339.00	81,865,000
日本航空	25,000	3,985.00	99,625,000
西本W I S M E T T A C H D	12,500	4,715.00	58,937,500
日本電信電話	45,000	5,266.00	236,970,000

KDDI	85,000	2,884.00	245,140,000	
NTTドコモ	65,000	2,792.50	181,512,500	
東京ドーム	47,500	1,074.00	51,015,000	
アイ・エス・ビー	15,000	2,163.00	32,445,000	
丹青社	80,000	1,302.00	104,160,000	
日鉄住金物産	10,000	6,080.00	60,800,000	
パーカーコーポレーション	20,000	595.00	11,900,000	
ソフトバンクグループ	12,500	8,355.00	104,437,500	
合計			19,770,643,000	

- (2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

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

インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成29年11月11日から平成30年5月10日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 財務諸表

【インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【貸借対照表】

	前 期		当 期	
	平成29年11月10日現在		平成30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		11,281,713		11,603,956
親投資信託受益証券		936,636,517		874,812,489
流動資産合計		947,918,230		886,416,445
資産合計		947,918,230		886,416,445
負債の部				
流動負債				
未払収益分配金		1,580,630		1,533,469
未払解約金		-		263,353
未払受託者報酬		87,019		76,885
未払委託者報酬		2,132,325		1,883,835
その他未払費用		41,409		36,484
流動負債合計		3,841,383		3,794,026
負債合計		3,841,383		3,794,026
純資産の部				
元本等				
元本	1	1,053,753,555		1,022,313,195
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金 ()	2	109,676,708		139,690,776
(分配準備積立金)		12,173,720		15,373,121
元本等合計		944,076,847		882,622,419
純資産合計		944,076,847		882,622,419
負債純資産合計		947,918,230		886,416,445

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 平成29年5月11日 至 平成29年11月10日	自 平成29年11月11日 至 平成30年5月10日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
有価証券売買等損益	61,100,413	22,824,028
営業収益合計	61,100,413	22,824,028
営業費用		
支払利息	2,970	2,642
受託者報酬	276,624	243,196
委託者報酬	6,778,361	5,959,187
その他費用	41,409	36,495
営業費用合計	7,099,364	6,241,520
営業利益又は営業損失()	54,001,049	29,065,548
経常利益又は経常損失()	54,001,049	29,065,548
当期純利益又は当期純損失()	54,001,049	29,065,548
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	1,837,748	491,167
期首剰余金又は期首欠損金()	179,537,142	109,676,708
剰余金増加額又は欠損金減少額	24,195,071	4,673,972
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	24,195,071	4,673,972
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,372,718	1,487,123
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,372,718	1,487,123
分配金	5,125,220	4,626,536
期末剰余金又は期末欠損金()	109,676,708	139,690,776

(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29年11月11日	至 平成30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29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
1. 1 期首元本額	1,226,276,494円	1,053,753,555円
期中追加設定元本額	10,558,332円	12,683,654円
期中一部解約元本額	183,081,271円	44,124,014円
2. 特定期間末日における受益権の総数	1,053,753,555口	1,022,313,195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109,676,708円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は139,690,776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29年5月11日 至 平成29年11月10日	自 平成29年11月11日 至 平成30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	286,583円	251,235円
2. 2 分配金の計算過程	（自平成29年5月11日 至平成29年7月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（4,265,094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（467,373円）及び分配準備積立金（8,750,688円）より分配対象額は13,483,155円（1万口当たり112.19円）であり、うち1,802,644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11月11日 至平成30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（3,266,033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（555,228円）及び分配準備積立金（11,890,494円）より分配対象額は15,711,755円（1万口当たり151.77円）であり、うち1,552,841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29年7月11日 至平成29年9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(1,726,049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(521,421円)及び分配準備積立金(10,770,080円)より分配対象額は13,017,550円(1万口当たり112.09円)であり、うち1,741,946円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成29年9月12日 至平成29年11月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,009,355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(487,854円)及び分配準備積立金(9,744,995円)より分配対象額は14,242,204円(1万口当たり135.16円)であり、うち1,580,630円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成30年1月11日 至平成30年3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(1,483,790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(623,231円)及び分配準備積立金(13,423,559円)より分配対象額は15,530,580円(1万口当たり151.25円)であり、うち1,540,226円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>
<p>(自平成29年9月12日 至平成29年11月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(4,009,355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(487,854円)及び分配準備積立金(9,744,995円)より分配対象額は14,242,204円(1万口当たり135.16円)であり、うち1,580,630円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成30年3月13日 至平成30年5月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,614,971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(638,896円)及び分配準備積立金(13,291,619円)より分配対象額は17,545,486円(1万口当たり171.63円)であり、うち1,533,469円(1万口当たり15円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成30年3月13日 至平成30年5月10日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(3,614,971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(638,896円)及び分配準備積立金(13,291,619円)より分配対象額は17,545,486円(1万口当たり171.63円)であり、うち1,533,469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29年11月11日 至 平成30年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク(価格変動、為替変動、金利変動等)、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 平成30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29年11月10日現在	当 期 平成30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	30,719,055	10,672,226
合計	30,719,055	10,672,226

(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29年11月10日現在	当 期 平成30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29年11月11日 至 平成30年5月10日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前 期 平成29年11月10日現在	当 期 平成30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)	0.8959円 (8,959円)	0.8634円 (8,634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	371,710,519	613,359,527	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	19,940,781	44,232,640	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	28,740,608	87,457,670	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	11,555,045	28,884,145	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	16,824,713	28,302,532	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	12,431,375	28,196,844	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	18,104,325	44,379,131	
親投資信託受益証券 合計			874,812,489	
合計			874,812,489	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）」に記載のとおりであります。

成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成29年11月11日から平成30年5月10日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1 財務諸表

【成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）】

(1) 【貸借対照表】

	前 期		当 期	
	平成29年11月10日現在		平成30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		71,628,581		67,141,748
親投資信託受益証券		5,016,154,313		4,616,205,944
未収入金		5,000,000		3,000,000
流動資産合計		5,092,782,894		4,686,347,692
資産合計		5,092,782,894		4,686,347,692
負債の部				
流動負債				
未払収益分配金		19,872,866		18,912,200
未払解約金		2,965,867		2,955,864
未払受託者報酬		448,336		403,400
未払委託者報酬		11,657,290		10,488,871
その他未払費用		207,185		194,265
流動負債合計		35,151,544		32,954,600
負債合計		35,151,544		32,954,600
純資産の部				
元本等				
元本	1	4,968,216,684		4,728,050,037
剰余金				
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2	89,414,666		74,656,945
（分配準備積立金）		287,504,123		409,498,945
元本等合計		5,057,631,350		4,653,393,092
純資産合計		5,057,631,350		4,653,393,092
負債純資産合計		5,092,782,894		4,686,347,692

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 平成29年5月11日 至 平成29年11月10日	自 平成29年11月11日 至 平成30年5月10日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
有価証券売買等損益	449,238,891	45,948,369
営業収益合計	449,238,891	45,948,369
営業費用		
支払利息	14,097	13,589
受託者報酬	1,381,803	1,292,282
委託者報酬	35,928,144	33,600,593
その他費用	207,185	194,326
営業費用合計	37,531,229	35,100,790
営業利益又は営業損失 ()	411,707,662	81,049,159
経常利益又は経常損失 ()	411,707,662	81,049,159
当期純利益又は当期純損失 ()	411,707,662	81,049,159
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()	9,160,929	2,270,918
期首剰余金又は期首欠損金 ()	280,567,656	89,414,666
剰余金増加額又は欠損金減少額	31,214,779	350,189
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	31,214,779	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	-	350,189
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,937,072	4,077,439
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	-	4,077,439
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	1,937,072	-
分配金	61,842,118	81,566,120
期末剰余金又は期末欠損金 ()	89,414,666	74,656,945

(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29年11月11日	至 平成30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29年11月10日現在	平成30年5月10日現在
1. 1 期首元本額	5,567,958,166円	4,968,216,684円
期中追加設定元本額	54,376,920円	42,388,187円
期中一部解約元本額	654,118,402円	282,554,834円
2. 特定期間末日における受益権の総数	4,968,216,684口	4,728,050,037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74,656,945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29年5月11日 至 平成29年11月10日	自 平成29年11月11日 至 平成30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	3,560,727円	3,325,123円
2. 2 分配金の計算過程	（自平成29年5月11日 至平成29年7月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（22,099,613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（8,335,531円）及び分配準備積立金（237,526,638円）より分配対象額は267,961,782円（1万口当たり502.90円）であり、うち21,313,506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11月11日 至平成30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（14,696,358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（178,206,430円）、投資信託約款に規定される収益調整金（10,167,123円）及び分配準備積立金（278,808,785円）より分配対象額は481,878,696円（1万口当たり996.63円）であり、うち43,515,810円（1万口当たり90円）を分配金額としております。

	<p>（自平成29年7月11日 至平成29年9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（3,343,621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（9,052,817円）及び分配準備積立金（230,005,480円）より分配対象額は242,401,918円（1万口当たり469.41円）であり、うち20,655,746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9月12日 至平成29年11月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（26,308,247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（77,114,475円）、投資信託約款に規定される収益調整金（9,406,896円）及び分配準備積立金（203,954,267円）より分配対象額は316,783,885円（1万口当たり637.62円）であり、うち19,872,866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30年1月11日 至平成30年3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（2,328,536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（11,207,423円）及び分配準備積立金（422,577,970円）より分配対象額は436,113,929円（1万口当たり911.51円）であり、うち19,138,110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30年3月13日 至平成30年5月10日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（28,443,614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（12,124,586円）及び分配準備積立金（399,967,531円）より分配対象額は440,535,731円（1万口当たり931.75円）であり、うち18,912,200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29年11月11日 至 平成30年5月10日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券、デリバティブ取引に投資しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。

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

金融商品の時価等に関する事項

区 分	当 期 平成30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29年11月10日現在	当 期 平成30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	367,581,347	73,812,155
合計	367,581,347	73,812,155

(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29年11月10日現在	当 期 平成30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29年11月11日 至 平成30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29年11月10日現在	当 期 平成30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)	1.0180円 (10,180円)	0.9842円 (9,842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	555,136,208	916,030,256	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	105,666,476	234,389,377	
	ダイワ好配当日本株マザーファンド	533,448,022	1,623,282,330	
	ダイワ北米好配当株マザーファンド	216,924,047	542,245,040	
	ダイワ欧州好配当株マザーファンド	320,562,608	539,250,419	
	ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド	233,357,045	529,300,449	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	94,524,568	231,708,073	
親投資信託受益証券 合計			4,616,205,944	
合計			4,616,205,944	

親投資信託受益証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券、「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券、「ダイワ北米好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」受益証券、「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」受益証券及び「ダイワ好配当日本株マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

なお、当ファンドの特定期間末日(以下、「期末日」)における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ北米好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ欧州好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ・アジア・オセアニア好配当株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

「ダイワ好配当日本株マザーファンド」の状況

前記「安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)」に記載のとおりであります。

2 【ファンドの現況】

原有価証券届出書の「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 2 ファンドの現況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）

【純資産額計算書】

平成30年5月31日

資産総額	956,654,504円
負債総額	724,866円
純資産総額（ - ）	955,929,638円
発行済数量	1,053,789,782口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9071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30年5月31日

資産総額	30,243,459,920円
負債総額	55,824,954円
純資産総額（ - ）	30,187,634,966円
発行済数量	18,529,897,619口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.6291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30年5月31日

資産総額	284,214,556,446円
負債総額	263,863,979円
純資産総額（ - ）	283,950,692,467円
発行済数量	226,030,324,728口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.2563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30年5月31日

資産総額	101,488,476,015円
負債総額	109,876,354円
純資産総額（ - ）	101,378,599,661円
発行済数量	46,021,989,029口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.2028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30年5月31日

資産総額	101,892,853,727円
負債総額	1,090,865,658円
純資産総額（ - ）	100,801,988,069円
発行済数量	41,018,912,389口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.4575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30年5月31日

資産総額	2,192,792,610円
負債総額	15,299,420円
純資産総額（ - ）	2,177,493,190円
発行済数量	870,862,789口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.5004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30年5月31日

資産総額	1,270,161,944円
負債総額	281円
純資産総額（ - ）	1,270,161,663円
発行済数量	795,256,146口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.5972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30年5月31日

資産総額	879,334,512円
負債総額	27,896,959円
純資産総額（ - ）	851,437,553円
発行済数量	378,878,160口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.2473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30年5月31日

資産総額	20,647,777,349円
負債総額	143,824,780円
純資産総額（ - ）	20,503,952,569円
発行済数量	6,856,978,588口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.9902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30年5月31日

資産総額	867,852,978円
負債総額	701,810円
純資産総額（ - ）	867,151,168円
発行済数量	1,018,077,925口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.8518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30年5月31日

資産総額	4,557,259,665円
負債総額	4,359,475円
純資産総額（ - ）	4,552,900,190円
発行済数量	4,703,480,964口
1単位当たり純資産額（ / ）	0.9680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

2018年5月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間に於ける資本金の額の増減：該当事項はありません。

b. 委託会社の機構

会社の意思決定機構

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

取締役会は、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。

2018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	81	189,786
追加型株式投資信託	703	15,257,861
株式投資信託 合計	784	15,447,647
単位型公社債投資信託	25	103,230
追加型公社債投資信託	14	1,497,345
公社債投資信託 合計	39	1,600,575
総合計	823	17,048,222

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29年4月1日から平成30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29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,260	28,709
有価証券	110	0
前払費用	190	201
未収委託者報酬	10,453	12,368
未収収益	72	82
繰延税金資産	439	552
その他	34	47
流動資産計	42,560	41,962
固定資産		
有形固定資産	1	213
建物	15	12
器具備品	214	200
無形固定資産	2,650	2,614
ソフトウェア	2,323	2,456
ソフトウェア仮勘定	327	158
投資その他の資産	12,353	15,066
投資有価証券	5,920	8,600
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	185	183
長期差入保証金	1,050	1,072
繰延税金資産	31	45

その他	37	34
固定資産計	15,234	17,894
資産合計	57,795	59,856

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	79	65
未払金	9,466	9,747
未払収益分配金	7	8
未払償還金	59	59
未払手数料	4,453	5,202
その他未払金	2	4,476
未払費用	4,077	4,148
未払法人税等	980	850
未払消費税等	223	583
賞与引当金	945	1,012
その他	3	335
流動負債計	15,776	16,744
固定負債		
退職給付引当金	2,318	2,350
役員退職慰労引当金	151	125
その他	7	5
固定負債計	2,477	2,481
負債合計	18,254	19,225
純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	12,231	13,370

利益剰余金合計	12,606	13,744
株主資本合計	39,276	40,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	264	216
評価・換算差額等合計	264	216
純資産合計	39,540	40,631
負債・純資産合計	57,795	59,856

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	79,747	82,510
その他営業収益	727	733
営業収益計	80,474	83,244
営業費用		
支払手数料	40,110	40,392
広告宣伝費	549	673
調査費	9,436	9,816
調査費	904	955
委託調査費	8,531	8,860
委託計算費	793	839
営業雑経費	1,375	1,579
通信費	251	249
印刷費	501	500
協会費	50	53
諸会費	13	13
その他営業雑経費	557	762
営業費用計	52,265	53,300
一般管理費		
給料	5,833	5,840
役員報酬	416	377
給料・手当	3,940	3,973
賞与	531	477
賞与引当金繰入額	945	1,012
福利厚生費	807	788
交際費	60	55
旅費交通費	178	195

租税公課	531	501
不動産賃借料	1,273	1,281
退職給付費用	463	316
役員退職慰労引当金繰入額	60	46
固定資産減価償却費	1,045	977
諸経費	1,400	1,528
一般管理費計	11,655	11,531
営業利益	16,554	18,411

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31 日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	92	75
投資有価証券売却益	224	210
有価証券償還益	94	17
その他	69	55
営業外収益計	481	359
営業外費用		
投資有価証券売却損	24	0
その他	75	29
営業外費用計	100	29
経常利益	16,935	18,741
特別損失		
MMF等償還関連費用	305	-
関係会社整理損失	-	333
特別損失計	305	333
税引前当期純利益	16,629	18,407
法人税、住民税及び事業税	6,501	5,843
法人税等調整額	1,405	106
法人税等合計	5,096	5,737
当期純利益	11,533	12,670

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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	12,231	12,606	39,276

当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414

	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	264	264	39,540
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	40,631

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」に独立掲記しておりました「受取利息」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」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」に表示していた「受取利息」12百万円、「その他」56百万円は、「その他」69百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
建物	26百万円	29百万円
器具備品	264百万円	235百万円

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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
未払金	4,877百万円	4,406百万円

3 保証債務

前事業年度(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。

当事業年度(平成30年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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29年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	平成29年 3月31日	平成29年 6月27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30年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

剰余金の配当の総額	12,669百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,857円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月26日

（金融商品関係）

1．金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「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代行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29年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	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 その他有価証券	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(*2)	(3,409)	(3,409)	-
負債計	(12,809)	(12,809)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 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30年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	28,709	28,709	-
(2) 未収委託者報酬	12,368	12,368	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	7,631	7,631	-
資産計	48,709	48,709	-
(1) 未払手数料	(5,202)	(5,202)	-
(2) その他未払金	(4,476)	(4,476)	-

(3) 未払費用(*2)	(3,286)	(3,286)	-
負債計	(12,965)	(12,965)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

(*2) 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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	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	1,050	1,072

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 その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

当事業年度(平成30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	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

(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、記載していません。

当事業年度(平成30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、記載していません。

2. その他有価証券

前事業年度(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」には含めていません。

当事業年度(平成30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	134	55	79
(2) その他 証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
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	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

(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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

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いません。

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
退職給付債務の期首 残高	2,209百万円	2,318百万円
勤務費用	202	159
退職給付の支払額	122	166
その他	29	38
退職給付債務の期末 残高	2,318	2,350

(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28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,318百万円	2,350百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350
退職給付引当金	2,318	2,350
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,318	2,350

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
勤務費用	202百万円	159百万円
その他	87	24
確定給付制度に係る退職給付費用	289	184

3. 確定拠出制度

社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度173百万円、当事業年度171百万円であります。

(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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
繰延税金資産		
退職給付引当金		719
	709	
賞与引当金	224	244
未払事業税	169	162
出資金評価損	98	94
投資有価証券評価損	65	68
連結法人間取引（譲渡損）	5	5
その他	185	308
繰延税金資産小計	1,458	1,602
評価性引当額	201	200
繰延税金資産合計	1,257	1,402
繰延税金負債		
連結法人間取引（譲渡益）	639	639
その他有価証券評価差額金	146	164
繰延税金負債合計	786	804
繰延税金資産の純額	470	598

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29年3月31日）

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。

当事業年度（平成30年3月31日）

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。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成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。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30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)	1,701	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	-------------	------	---------	-------	---	---

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㈱	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	㈱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㈱	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。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30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㈱	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)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	㈱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)	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	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)	1,048	長期差入保証金	1,055

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28年4月1日 至 平成29年3月31日)		当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,158.25円	1株当たり純資産額	15,576.40円
1株当たり当期純利益	4,421.51円	1株当たり当期純利益	4,857.40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28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
当期純利益(百万円)	11,533	12,670
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

<訂正後>

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

(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（2018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 (2018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	
ニューズ証券株式会社	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	21,317	
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	25,173	(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	
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	銀行法に基づき 銀行業を営んでいます。
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)	2,421,437	

(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 511千ドル(約57百万円)(2017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 アムンディ・アイルランド・リミテッド

資本金の額 1,032,912ユーロ(約139百万円)(2017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(2018年3月末日現在)

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

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

独立監査人の監査報告書

平成30年6月15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29年11月11日から平成30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30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30年6月15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29年11月11日から平成30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30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30年6月15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29年11月11日から平成30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30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30年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59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30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。