

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2019年11月29日提出
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社 (2020年4月1日より、大和アセットマネジメント株式会社(予定))
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松下 浩一
【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】	西脇 保宏 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】	世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部 【証券情報】

### (1) 【ファンドの名称】

世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）（愛称：ベストシックス）

### (2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付もありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

### (3) 【発行(売出)価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）  
電話番号（コールセンター） 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ  
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

### (5) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.75%（税抜2.5%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）  
電話番号（コールセンター） 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が課されます。

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

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

(7) 【申込期間】

2019年11月30日から2020年5月29日まで（継続申込期間）

（終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。）

(8) 【申込取扱場所】

委託会社にお問合わせ下さい。また、委託会社のホームページでご覧になることもできます。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

- ・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

(9) 【払込期日】

受益権の取得申込者は、販売会社が定める期日（くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。）までに、取得申込代金（取得申込金額、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する金額の合計額をいいます。以下同じ。）を販売会社において支払うものとします。

販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

(10) 【払込取扱場所】

受益権の取得申込者は、取得申込代金を、申込取扱場所において支払うものとします。申込取扱場所については、前(8)をご参照下さい。

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。

株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

受益権の取得申込者は、申込取扱場所において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得および換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。取扱い可能なコースについては、販売会社にお問合わせ下さい。なお、コース名は、販売会社により異なる場合があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約を締結します。なお、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定が用いられることがあり、この場合上記の契約または規定は、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、一部解約金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

- ・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

## 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】

当ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。一般社団法人投資信託協会による商品分類・属性区分は、次のとおりです。

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	資産複合
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券、不動産投信）））
	決算頻度	年12回（毎月）
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファミリーファンド
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

##### (注1) 商品分類の定義

- ・「追加型投信」...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンド
- ・「内外」...目論見書または投資信託約款（以下「目論見書等」といいます。）において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの
- ・「資産複合」...目論見書等において、株式、債券、不動産投信（リート）およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるもの

##### (注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」...組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分固定型」...目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- ・「年12回（毎月）」...目論見書等において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」...目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファミリーファンド」...目論見書等において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するもの
- ・「為替ヘッジなし」...目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの

## 商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）
単位型投信	国内	株式
追加型投信	海外	債券
	内外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (含む日本)		
債券 一般	年2回	日本	ファミリー ファンド	あり ( )
公債	年4回	北米		
社債	年6回 (隔月)	欧州		
その他債券 クレジット属性 ( )		アジア		
不動産投信	年12回 (毎月)	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 資産配分固定型 (株式、債券、不動産投信)))	日々	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
資産複合 ( )	その他 ( )	アフリカ		
資産配分固定型		中近東 (中東)		
資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

商品分類・属性区分の定義について、くわしくは、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス <http://www.toushin.or.jp/>）をご参照下さい。

## &lt; 信託金の限度額 &gt;

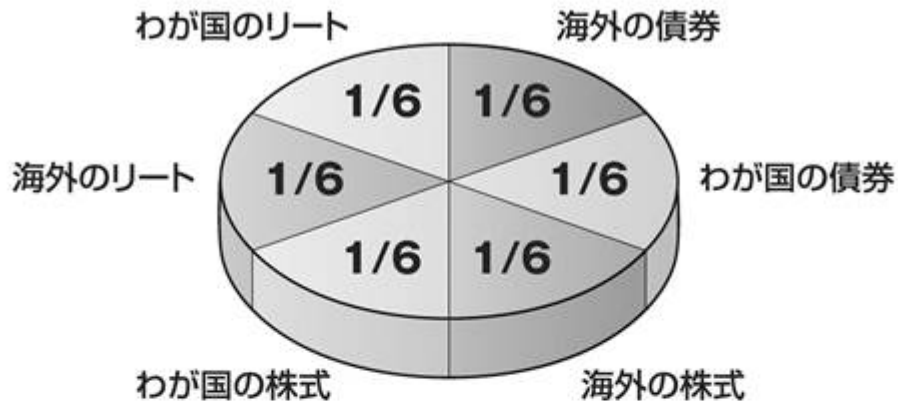
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、2,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

## &lt; ファンドの特色 &gt;

## 1

内外の債券、株式およびリートに投資します。

●各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処とします。



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

## ファンドの仕組み

●当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。

ファミリーファンド方式とは、投資者のみなさまからお預かりした資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。



## 2

## 海外の債券への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

※「ソブリン債等」とは、国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債などをいいます。

- ドル通貨圏（米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等）、欧州通貨圏（ユーロ、ポンド、北欧通貨および東欧通貨等）の2つの通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の50%程度ずつとすることを基本とします。
- ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします。

## ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度 欧州通貨圏：50%程度



※北欧通貨：スウェーデン・クローネ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

※欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。

(注) 上記はイメージであり、実際の投資割合が上記のとおりとなるとは限りません。

- 国債の格付けは、取得時においてA格相当以上<sup>\*1</sup>、国債以外の格付けは、取得時においてAA格相当以上<sup>\*2</sup>とすることを基本とします。

## 債券の格付けについて

信用度	ムーディーズの場合	S&Pの場合
高い	Aaa	AAA
	Aa { Aa1, Aa2, Aa3 }	AA { AA+, AA-, }
	A { A1, A2, A3 }	A { A+, A-, }
	Baa	BBB
	Ba	BB
	B	B
	Caa	CCC
	Ca	CC
低い	C	C
		D

債券の格付けとは、償還時までの債券の元本、利息の支払いの確実性に関する将来の見通しを示すもので、ムーディーズ (Moody's) やS&Pグローバル・レーティング (S&P) といった格付会社が各債券の格付けを行なっています。付与された格付けは、随時見直しが行なわれ、発行体の財務状況の変化などによって格上げや格下げが行なわれることがあります。

※1 ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上

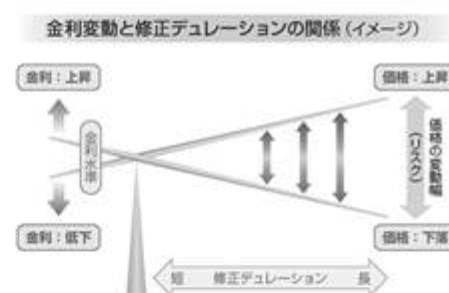
※2 ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上



- ポートフォリオの修正デュレーションは5（年）程度から10（年）程度の範囲を基本とします。

## 修正デュレーションについて

- 修正デュレーションとは、「金利が変動したときに債券価格がどのくらい変化するか」を示す指標です。
- 修正デュレーションが長いほど、金利が変動したときの債券価格の変動（ブレ幅）が大きくなります。



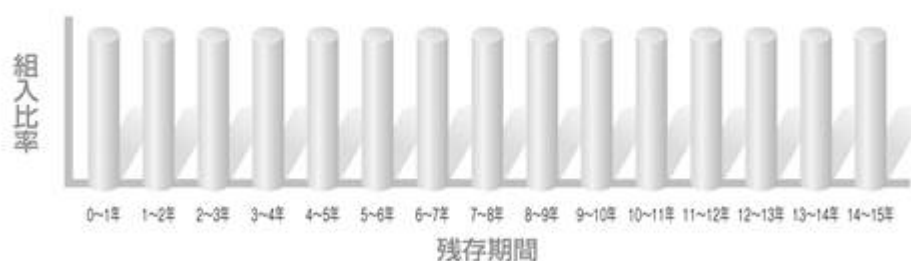
- 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

## 3

わが国の債券への投資にあたっては、国債に投資します。

- 残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。
- 原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間ごとの投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。

### 残存期間ごとの組入イメージ



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。

- ダイワ日本国債マザーファンドにおいて、国債の組入れは原則として高位を保ちます。
- 運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、債券の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、ダイワ日本国債マザーファンドの信託財産の純資産総額を超えることがあります。

## 4 内外の株式への投資にあたっては、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資します。

●ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針で行なうことを基本とします。

イ. 持続可能なより良い社会への企業の取組みに着目し、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄を選定します（外部調査機関による企業の社会的責任に関する調査等を参考にします。）。

ロ. 株価水準、流動性、分散等を考慮し、ポートフォリオを構築します。

### 〈海外の株式〉

銘柄選定にあたっては、ドイツのイーコム・リサーチ・アーゲーの調査情報を参考にします。

◇イーコム・リサーチは、世界的な調査・格付会社の一つであり、環境への取組みを含めた企業責任の格付け（Corporate Responsibility格付け）等を行なっています。

◇イーコム・リサーチの企業責任の格付けは、環境的側面と社会的・文化的側面において行なわれ、それらをベースとした総合格付けが行なわれます。

（委託会社に対してダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドの運用にかかる投資助言を行なうものではありません。）

### 〈わが国の株式〉

銘柄選定にあたっては、株式会社日本総合研究所の調査情報を参考にします。

◇日本総合研究所は、1969年に設立された日本を代表するシンクタンクです。

◇日本総合研究所は、企業の「社会的責任」（社会的側面、環境的側面）の調査を行ないます。なお、日本総合研究所は、投資助言・代理業の登録を行なっておらず、有価証券の価値等または有価証券の価値等の分析に基づく投資判断の助言を行なうものではありません。

## 5

内外のリートへの投資にあたっては、個別銘柄の投資価値を分析して、配当利回り、期待される成長性、割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。

- 海外のリートへの投資にあたっては、組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。
- 海外のリーートの運用は、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクが行いません。

ダイワ・グローバルREIT・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、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。

## 投資対象銘柄の業種 (イメージ)



## 投資対象地域 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

## 〈コーヘン&amp;スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて〉

- ・米国最初のリート専門の運用会社として1986年7月に設立。
- ・リート運用では最大級の資産規模。
- ・ワールドワイドなリサーチ力と運用力を有する。
- ・優先リートを含むハイブリッド証券などのインカム資産に加え、インフラ株といった実物資産クラスの運用を展開。
- ・所在地：アメリカ合衆国 ニューヨーク州 ニューヨーク

- わが国のリートへの投資にあたっては、個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

## 投資対象銘柄の業種 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

・保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

・大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～5.の運用が行なわれないことがあります。

## 6 毎月6日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

### 〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざして分配金額を決定します。ただし、基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益（評価益を含みます。）等を中心に6月と12月の計算期末に分配する場合があります。また、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

### 収益分配のイメージ



- ・上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
- ・分配金額は、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。
- ・ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。

## 【収益分配金に関する留意事項】

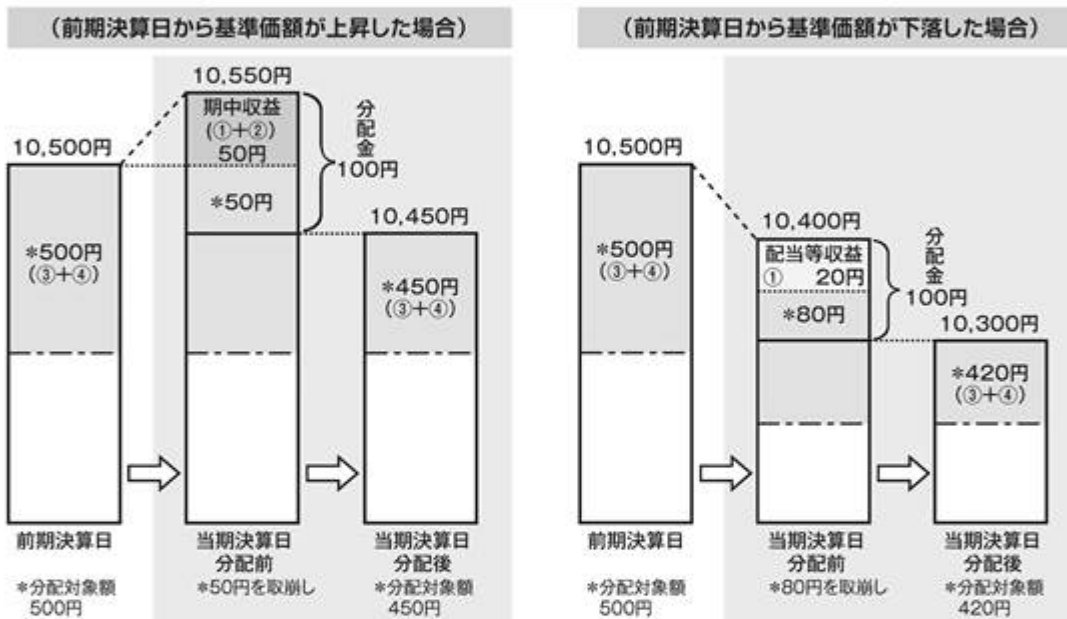
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

投資信託で分配金が支払われるイメージ



- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

（計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合）



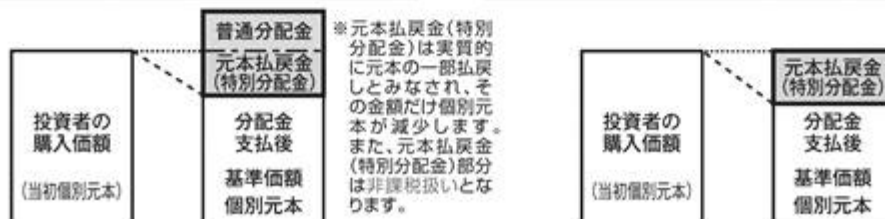
(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意下さい。

- 投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりがかさかった場合も同様です。

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）

（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



普通分配金 … 個別元本(投資者のファンドの購入価額)を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金 … 個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者の個別元本は、元本払戻金(特別分配金)の額だけ(特別分配金)減少します。

(注) 普通分配金に対する課税については、「4 手数料等及び税金 (5) 課税上の取扱い」をご参照下さい。

## (2) 【ファンドの沿革】

2006年6月28日

信託契約締結、当初設定、運用開始

## (3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

## 収益分配金(注1)、償還金など お申込金(5)

お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約(1)に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
-------	------	--

1

## 収益分配金、償還金など お申込金(5)

委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約(以下「信託契約」といいます。)(2)の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
------	----------------	---

運用指図

2

## 損益 信託金(5)

受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社</p>	<p>信託契約(2)の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、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。</p> <p>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 など</p>
------	--	--

## 損益 投資

投資対象	<p>内外の公社債、不動産投資信託証券および株式 など</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・ファミリーファンド方式で運用を行ないます。</li> <li>・なお、「ダイワ・グローバルREIT・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(コーヘン&amp;スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク)(注2)に運用の指図にかかる権限を委託します。</li> </ul>
------	---

(注1)「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

(注2)投資顧問会社は、委託会社との間の運用委託契約(3)に基づき、委託会社から権限の委託を受けて、同マザーファンドにおける外貨建資産の運用の指図を行ないます(4)。

- 1: 受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2: 「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項(運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等)が規定されています。
- 3: 運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等が定められています。

- 4：投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。
- 5：販売会社は、各取得申込受付日における取得申込金額の総額に相当する金額を、追加信託が行なわれる日に、委託会社の指定する口座を經由して、受託会社の指定するファンド口座に払込みます。

委託会社および受託会社は、それぞれの業務に対する報酬を信託財産から収受します。また、販売会社には、委託会社から業務に対する代行手数料が支払われます。

< 委託会社の概況（2019年9月末日現在） >

・ 資本金の額 151億7,427万2,500円

・ 沿革

- 1959年12月12日 設立登記
- 1960年 2月17日 「証券投資信託法」に基づく証券投資信託の委託会社の免許取得
- 1960年 4月 1日 営業開始
- 1985年11月 8日 投資助言・情報提供業務に関する兼業承認を受ける。
- 1995年 5月31日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づき投資顧問業の登録を受ける。
- 1995年 9月14日 「有価証券に係る投資顧問業の規制等に関する法律」に基づく投資一任契約にかかる業務の認可を受ける。
- 2007年 9月30日 「金融商品取引法」の施行に伴い、同法第29条の登録を受けたものとみなされる。  
(金融商品取引業者登録番号：関東財務局長(金商)第352号)

・ 大株主の状況

名 称	住 所	所有 株式数	比率
株式会社大和証券グループ本社	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号	株 2,608,525	% 100.00

## 2 【投資方針】

### (1) 【投資方針】

#### 主要投資対象

下記の各マザーファンド(以下総称して「マザーファンド」といいます。)の受益証券を主要投資対象とします。

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
2. ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券
3. ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券
4. ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券
5. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券
6. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券

#### 投資態度

- イ．主として、マザーファンドを通じて内外の公社債、株式、および不動産投資信託証券に投資を行ない、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。
- ロ．各マザーファンドの受益証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。
- ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の6分の1
- ダイワ日本国債マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の6分の1
- ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の6分の1
- ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の6分の1
- ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の6分の1
- ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券...信託財産の純資産総額の6分の1
- ハ．保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。
- ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、大和証券投資信託委託株式会社を委託者とし、三井住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券、ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの

3．外国法人が発行する譲渡性預金証書

4．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3．コール・ローン

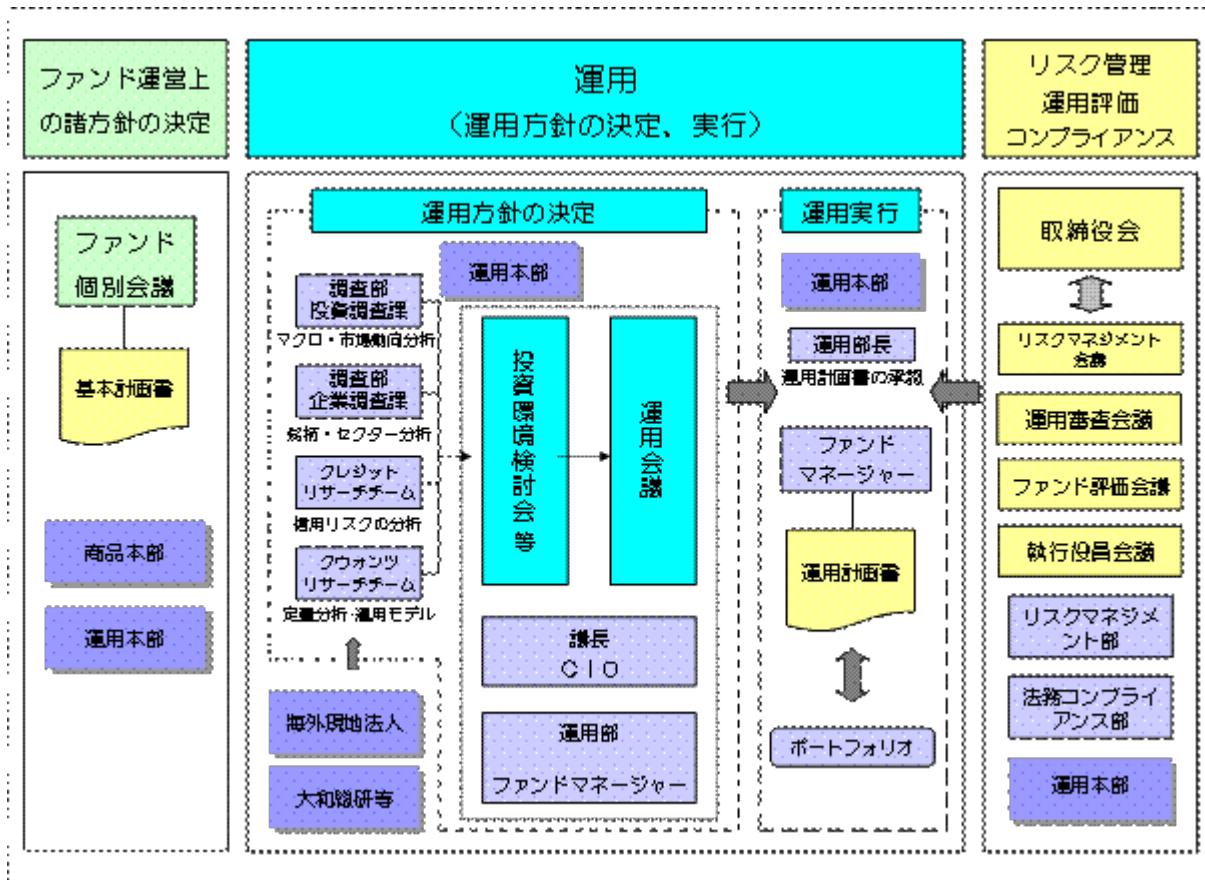
4．手形割引市場において売買される手形



## (3) 【運用体制】

## 運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



## 運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

## イ．基本計画書の策定

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．投資環境の検討

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．基本的な運用方針の決定

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．運用計画書の作成・承認

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。

## 職務権限

ファンド運用の意思決定機能を担う運用本部において、各職位の主たる職務権限は、社内規則によって、次のように定められています。

## イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更
- ・運用会議の議長として、基本的な運用方針の決定
- ・各ファンドの分配政策の決定
- ・代表取締役に対する随時的確な状況報告
- ・その他ファンドの運用に関する重要事項の決定

## ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

## ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

## ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

## ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

## イ．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。

## ロ．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。

## ハ．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。

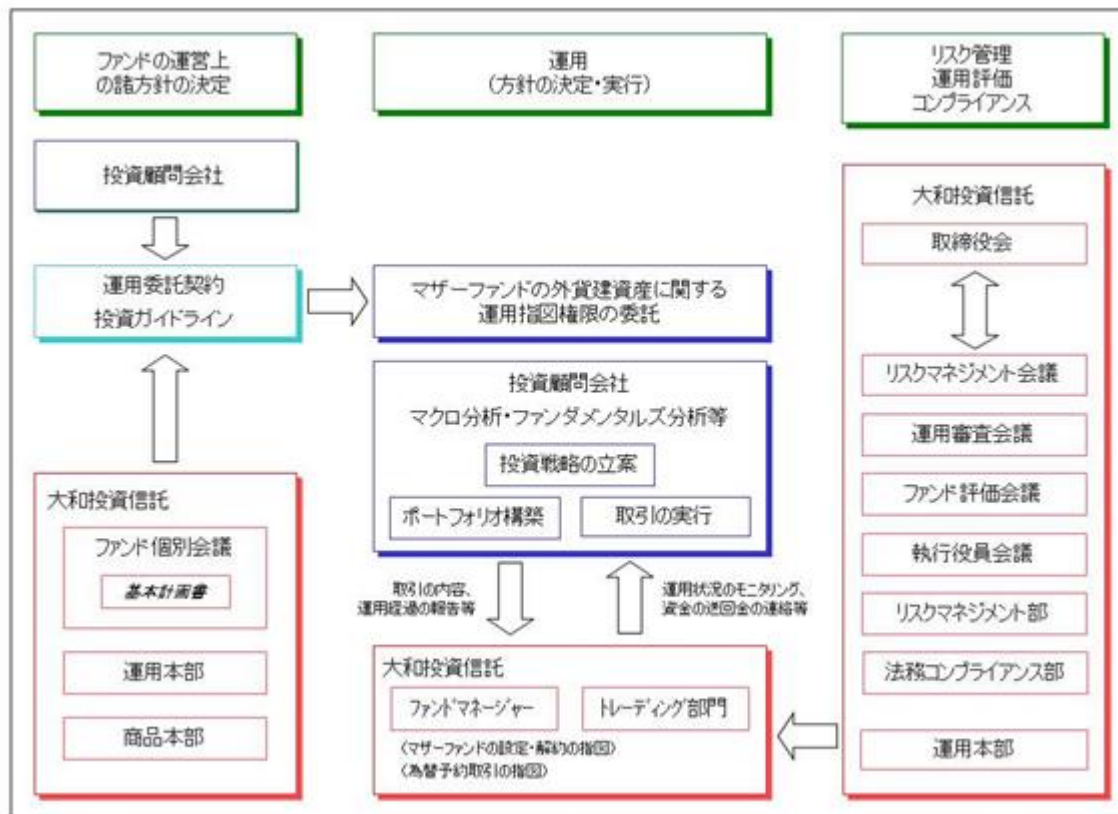
## ニ．執行役員会議

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。

受託会社に対する管理体制

受託会社に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行なっています。また、受託会社より内部統制の整備および運用状況の報告書を受け取っています。

海外リートにかかる運用体制について（マザーファンドにかかるものを含みます。）



#### イ．ファンド運営上の諸方針の決定

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。なお、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」では、投資顧問会社に外貨建資産の運用の指図にかかる権限を委託します。このため、当該投資顧問会社と委託会社の間で締結する運用委託契約に基づく投資ガイドラインに、このファンド運営上の諸方針が反映されます。

#### ロ．運用の実行

投資顧問会社は、投資ガイドラインに基づき、投資戦略の立案、ポートフォリオ構築を行ない、取引を実行します。

#### ハ．モニタリング

委託会社は、投資顧問会社との間で取引の内容、運用経過の報告等を受け、資金動向等について必要な連絡を取るとともに、運用の状況、投資ガイドラインの遵守状況等をモニタリングします。

また、定期的なアンケートの実施およびコンプライアンスレポートの徴求により、運用体制、管理体制、コンプライアンス体制等についての報告を受けています。さらに、現地訪問による調査も行なっています。これらの報告および調査をもとに評価を行ない、委託会社でのファンド個別会議へ報告しています。

#### ニ．リスク管理、運用評価、コンプライアンス

（前 に同じ。）

上記の運用体制は2019年9月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

#### (4) 【分配方針】

分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。

原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざして分配金額を決定します。ただし、基準価額の水準等によっては、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮して売買益(評価益を含みます。)等を中心に6月と12月の計算期末に分配する場合があります。また、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。なお、第1、第2および第3計算期末には、収益の分配は行ないません。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

#### (5) 【投資制限】

株式(信託約款)

株式への直接投資は、行ないません。

外貨建資産(信託約款)

外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約取引(信託約款)

委託会社は、信託財産に属する外貨建資産とマザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額(信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。)との合計額について、当該外貨建資産の為替ヘッジのため、外国為替の売買の予約を指図することができます。

信用リスク集中回避(信託約款)

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

資金の借入れ(信託約款)

イ. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

ロ. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

ハ. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

ニ. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

## &lt;参考&gt; マザーファンドの概要

1. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

## (1) 投資方針

## 主要投資対象

内外の公社債等を主要投資対象とします。

## 投資態度

イ．主として海外のソブリン債等（国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債など）に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。

ロ．海外のソブリン債等への投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。

a．米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等をドル通貨圏、ユーロ、ポンド、北欧通貨および東欧通貨等を欧州通貨圏とし、2通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の50%程度ずつとすることを基本とします。

北欧通貨：スウェーデン・クローネ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ

東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

b．ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします（ただし、欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。）。

c．国債については、取得時においてA格相当以上（ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上）とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてA格相当以上（ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上）とすることを基本とします。

d．ポートフォリオの修正デュレーションは5（年）程度から10（年）程度の範囲を基本とします。

e．金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

ハ．為替については、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建資産の投資比率合計を、信託財産の純資産総額の100%に近づけることを基本とします。

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限り。）

ハ．約束手形

二．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した外国通貨表示の株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. コマーシャル・ペーパー
8. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前7.までの証券または証書の性質を有するもの
9. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
10. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
11. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
12. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
13. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
14. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
15. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
16. 外国の者に対する権利で前15.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

### (3) 主な投資制限

株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限りします。

株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

イ．委託会社は、わが国の金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号イもしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。

ロ．委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。

ハ．委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。

スワップ取引

イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## 2. ダイワ日本国債マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### 投資態度

- イ．主としてわが国の国債に投資し、残存期間の異なる債券の利息収入を幅広く確保することをめざして運用を行ないます。
- ロ．わが国の国債への投資にあたっては、原則として、最長15年程度までの国債を、各残存期間ごとの投資金額がほぼ同程度となるように組入れます。
- ハ．国債の組入れは原則として高位を保ちます。
- ニ．運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
- ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

### (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

- 1.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）
- 2.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）



委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1. 転換社債の転換、新株予約権（新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の新株予約権に限ります。）の行使、社債権者割当または株主割当により取得した株券または新株引受権証書

2.～16.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

なお、前1.の証券または証書、前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前8.ならびに前12.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前9.の証券および前10.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

### (3) 主な投資制限

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

イ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

ロ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの八.と同規定）

スワップ取引

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。

ロ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

ハ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

ホ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

金利先渡取引

イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

ロ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

ハ.（ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドと同規定）

ニ. 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。

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

## 3. ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド

## (1) 投資方針

### 主要投資対象

海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式（上場予定および登録予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

### 投資態度

イ．主として海外の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式の中から、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資することにより、信託財産の成長をめざします。

ロ．ポートフォリオの構築にあたっては、以下の方針で行なうことを基本とします。

(a) 持続可能なより良い社会への企業の取組みに着目し、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄を選定します（外部調査機関による企業の社会的責任に関する調査等を参考にします。）。

(b) 株価水準、流動性、分散等を考慮し、ポートフォリオを構築します。

ハ．株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上とすることを基本とします。

ニ．保有外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払いにかかる為替予約等を行なうことができるものとします。

ホ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

ニ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．外国通貨表示の株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 外国通貨表示の新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
19. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの

なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前5.の権利の性質を有するもの

### (3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

先物取引等

イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の

範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。)

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額(組入有価証券を差引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

ロ. 委託会社は、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の売予約と合わせて、保有外貨建資産の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、為替の買予約と合わせて、外貨建有価証券の買付代金等実需の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有外貨建資産の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

ハ. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品(信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。)の時価総額の範囲内とします。
2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。ただし、保有金利商品が外貨建てで、信託財産の外貨建資産組入可能額(約款上の組入可能額から保有外貨建資産の時価総額を差引いた額。以下同じ。)に信託財産が限月までに受取る外貨建組入公社債および組入外国貸付債権信託受益証券ならびに外貨建組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額が当該金融商品運用額等の額より少ない場合には外貨建資産組入可能額に信託財産が限月までに受取る外貨建組入有価証券にかかる利払金および償還金等を加えた額を限度とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

スワップ取引

- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ．委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。
- 金利先渡取引および為替先渡取引
- イ．委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ．金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ．金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ．為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる為替先渡取引の想定元本の総額が、保有外貨建資産の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有外貨建資産の時価総額が減少して、為替先渡取引の想定元本の総額が保有外貨建資産の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ホ．金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ヘ．委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 4. ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド

##### (1) 投資方針

###### 主要投資対象

わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

###### 投資態度

- イ．主としてわが国の金融商品取引所上場株式の中から、中長期的に企業価値の向上が期待される銘柄に投資することにより、信託財産の成長をめざします。

ロ。（ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンドと同規定）

ハ．株式の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の90%程度以上とすることを基本とします。

二．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)、および に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形

二．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

- 1．株券または新株引受権証券
- 2．国債証券
- 3．地方債証券
- 4．特別の法律により法人の発行する債券
- 5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.から前11.までの証券または証書の性質を有するもの
- 13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

14. 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
16. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
17. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
18. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
19. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
20. 外国の者に対する権利で前19.の有価証券の性質を有するもの  
なお、前1.の証券または証書、前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、前2.から前6.までの証券および前12.ならびに前16.の証券または証書のうち前2.から前6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、前13.の証券および前14.の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。  
（ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンドと同規定）

### (3) 主な投資制限

株式への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行ないません。

先物取引等

- イ. 委託会社は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
  1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。
  2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額（組入有価証券を差引いた額）に信託財産が限月までに受取る組入公社債および組入貸付債権信託受益権の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額（以下「金融商品運用額等」といいます。）の範囲内とします。
  3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。
- ロ. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における金利にかかるこれらの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことができます。
  1. 先物取引の売建ておよびコール・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、保有金利商品（信託財産が1年以内に受取る組入有価証券の利払金および償還金等ならびに前(2)の1.から4.までに掲げる金融商品で運用されているものをいいます。）の時価総額の範囲内とします。

2. 先物取引の買建ておよびプット・オプションの売付けの指図は、建玉の合計額が、信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに金融商品運用額等の範囲内とします。
3. コール・オプションおよびプット・オプションの買付けの指図は、支払いプレミアム額の合計額が取引時点の保有金利商品の時価総額の5%を上回らない範囲内とし、かつ全オプション取引にかかる支払いプレミアム額の合計額が取引時点の信託財産の純資産総額の5%を上回らない範囲内とします。

#### スワップ取引

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の総額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. スワップ取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ. 委託会社は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### 金利先渡取引

- イ. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ロ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ハ. 金利先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引の想定元本の総額が、保有金利商品の時価総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記保有金利商品の時価総額が減少して、金利先渡取引の想定元本の総額が保有金利商品の時価総額を超えることとなった場合には、委託会社は、すみやかにその超える額に相当する金利先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- ニ. 金利先渡取引の評価は、市場実勢金利をもとに算出した価額で行なうものとします。
- ホ. 委託会社は、金利先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## 5. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

### (1) 投資方針

#### 主要投資対象



海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）および店頭登録（登録予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

#### 投資態度

イ．海外の金融商品取引所上場および店頭登録の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして分散投資を行ないます。

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

(a) 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。

(b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。

ハ．外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。

ニ．不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。

ホ．外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。

ヘ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図することができます。

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前1.の証券または証書の性質を有するもの

3．外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）

4．外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

5．外国法人が発行する譲渡性預金証書

6．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、前3.の証券および前4.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1．預金

2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

## 3. コール・ローン

## 4. 手形割引市場において売買される手形

## (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

## (4) 運用指図権限の委託

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。

コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

New York, New York, USA

前 の規定にかかわらず、前 により委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

## 6. ダイワJ - REITアクティブ・マザーファンド

## (1) 投資方針

## 主要投資対象

わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。以下同じ。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）を主要投資対象とします。

## 投資態度

イ．わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。

ロ．投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。

(a) 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。

(b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

ハ．不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。

ニ．当初設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、上記の運用が行なわれないことがあります。

## (2) 投資対象

当ファンドにおいて投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条に掲げるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、後掲(3)に定めるものに限りま。

ハ．約束手形

二．金銭債権のうち、投資信託及び投資法人に関する法律施行規則第22条第1項第6号に掲げるもの

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます。

1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

2．投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)

3．投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)

4．新投資口予約権証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいい、不動産投資信託証券にかかる投資法人より発行されたものに限りま。

5．指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りま。

なお、前2.の証券および前3.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1．預金

2．指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)

3．コール・ローン

4．手形割引市場において売買される手形

### (3) 主な投資制限

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

先物取引

委託会社は、わが国の金融商品取引所における不動産投信指数先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものであって、不動産投信指数を対象とするものをいいます。)および外国の金融商品取引所におけるこの取引と類似の取引を次の範囲で行なうことの指図をすることができます。

1．先物取引の売建の指図は、建玉の合計額が、組入有価証券の時価総額の範囲内とします。

2．先物取引の買建の指図は、建玉の合計額が、有価証券の組入可能額(組入有価証券を差し引いた額)に信託財産が限月までに受取る組入公社債、組入外国貸付債権信託受益証券、組入貸付債権信託受益権、組入抵当証券および組入指定金銭信託の受益証券の利払金および償還金を加えた額を限度とし、かつ信託財産が限月までに受取る組入有価証券にかかる利払金および償還金等ならびに前(2) の1.から4.までに掲げる金融商品で運用している額(以下「金融商品運用額等」といいます。)の範囲内とします。

### 3 【投資リスク】

#### (1) 価額変動リスク

当ファンドは、株式、公社債、不動産投資信託証券など値動きのある証券（外国証券には為替リスクもあります。）に投資しますので、基準価額は大きく変動します。したがって、投資元本が保証されているものではなく、これを割込むことがあります。委託会社の指図に基づく行為により信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者に帰属します。

投資信託は預貯金とは異なります。

投資者のみなさまにおかれましては、当ファンドの内容・リスクを十分ご理解のうえお申込み下さいますよう、よろしくお願い申し上げます。

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

#### 株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

#### 公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

公社債の価格は、一般に金利が低下した場合には上昇し、金利が上昇した場合には下落します（値動きの幅は、残存期間、発行体、公社債の種類等により異なります。）。また、公社債の価格は、発行体の信用状況によっても変動します。特に、発行体が財政難、経営不安等により、利息および償還金をあらかじめ決定された条件で支払うことができなくなった場合（債務不履行）、またはできなくなることが予想される場合には、大きく下落します（利息および償還金が支払われないこともあります。）。組入公社債の価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

#### リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

イ．リートは、株式と同様に金融商品取引所等で売買され、その価格は、不動産市況に対する見通しや市場における需給等、さまざまな要因で変動します。

- ・リートには資産規模が小さく、流動性が低いものもあります。このようなリートへの投資は、流動性の高い株式等に比べ、より制約を受けることが考えられます。
- ・金利の上昇局面においては、他の、より利回りの高い債券等との比較でリートに対する投資価値が相対的に低下し、価格が下落することも想定されます。

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

- ・リートの収益は、所有する不動産から得られる賃料収入がその大半を占めます。したがって、賃料水準や入居率の低下等により賃料収入が減少した場合には、リートの収益が悪化し、価格や配当が下落することが考えられます。
- ・リートの資産価値は、所有する不動産の評価等により変動します。市況の悪化、不動産の老朽化等によってリートの資産価値が低下した場合には、価格が下落することがあります。なお、実物資産である不動産には、人的災害、自然災害等に伴って大きな損害が発生する可能性もあり、このような場合、リートの価格が大幅に下落することも想定されます。

- ・リートでは、投資資金を調達するために金融機関等から借入れを行なうことがあります。したがって、金利上昇局面において金利負担等が増加し、収益の悪化要因となることが考えられます。
  - ・法人形態のリートでは、経営陣の運営如何によっては収益や財務内容が著しく悪化する可能性があります。リートが倒産等に陥り、投資資金が回収できなくなることもありえます。
- ハ．リートに関する法制度(税制、会計制度等)が変更となった場合、リートの価格や配当に影響を与えることが想定されます。
- ・その他、不動産を取巻く規制(建築規制、環境規制等)に変更があった場合も、リートの価格や配当に影響を受けることが考えられます。
  - ・金融商品取引所が定める基準に抵触する等の理由から、リートが上場廃止になることもありえます。

ニ．組入リートの市場価格が下落した場合、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動のほか、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向に進んだ場合には、基準価額が下落する要因となり、投資元本を割込むことがあります。

当ファンドにおいては、保有実質外貨建資産について、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。そのため、外貨建資産を実質的に組入れた部分は、為替レートの変動の影響を直接受けます。

ロ．カンントリー・リスク

投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想外に下落したり、方針に沿った運用が困難となることがあります。

その他

イ．解約申込みがあった場合には、解約資金を手当てするため組入証券を売却しなければならないことがあります。その際、市場規模や市場動向によっては市場実勢を押下げ、当初期待される価格で売却できないこともあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

ロ．ファンド資産をコール・ローン、譲渡性預金証書等の短期金融資産で運用する場合、債務不履行により損失が発生することがあります(信用リスク)。この場合、基準価額が下落する要因となります。

## (2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

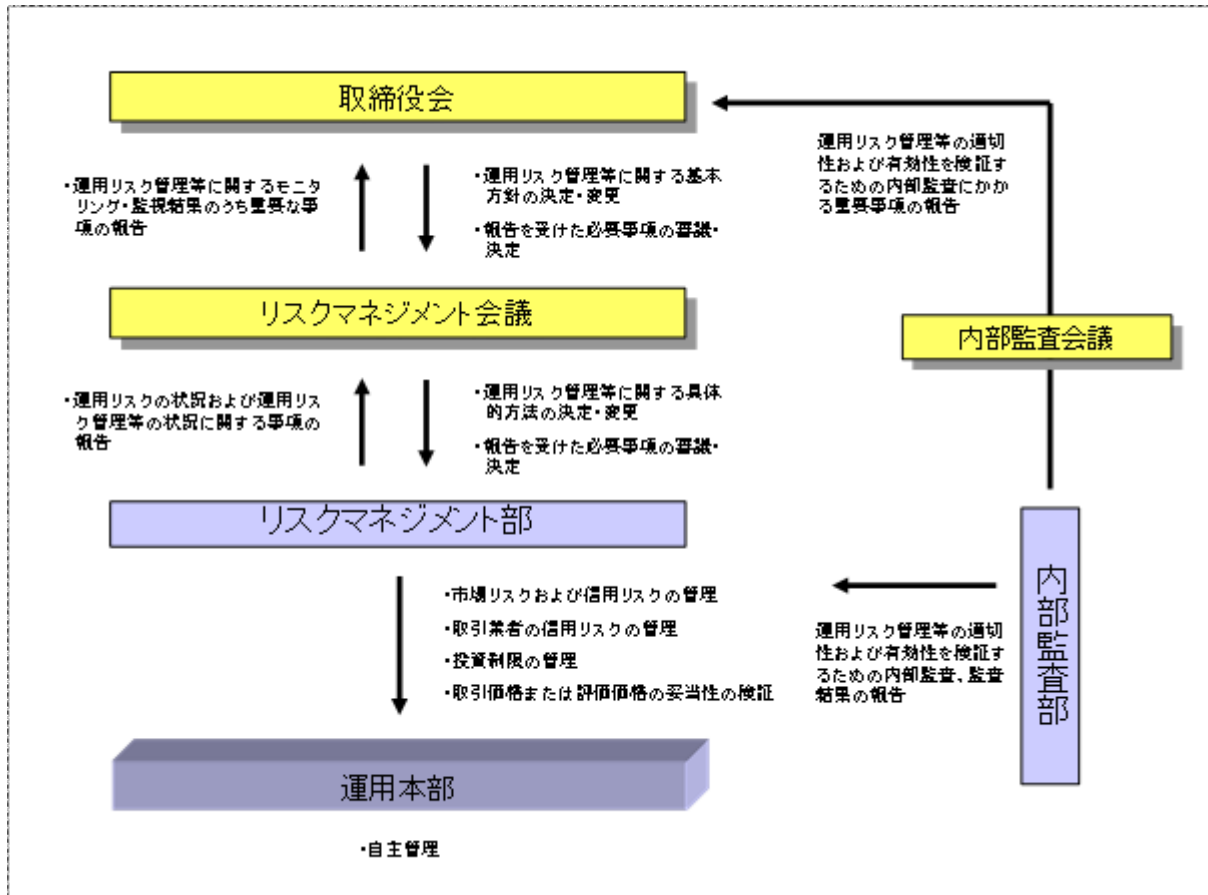
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

## (3) その他の留意点

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

## (4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。



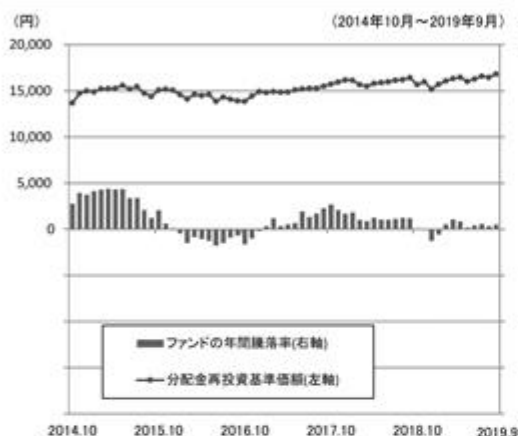
## 流動性リスクに対する管理体制

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

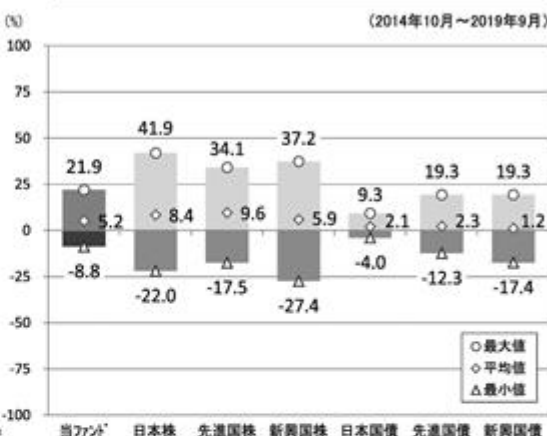
## 参 考 情 報

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

ファンドの年間騰落率と分配金再投資基準価額の推移



他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※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、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●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】

## (1) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.75%（税抜2.5%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

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

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

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.441%（税抜1.31%）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。

信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を、信託報酬支弁のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分は、次のとおりです。

委託会社	販売会社	受託会社
年率0.63% （税抜）	年率0.63% （税抜）	年率0.05% （税抜）

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

委託会社は、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を、次のとおり支払うものとします。

・ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

同マザーファンドの日々の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとします。

275億円以下の部分	年率0.57%
275億円超 1,000億円以下の部分	年率0.47%
1,000億円超 2,500億円以下の部分	年率0.37%
2,500億円超 4,500億円以下の部分	年率0.30%
4,500億円超の部分	年率0.25%



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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

#### (4) 【その他の手数料等】

信託財産において資金借入れを行なった場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用（データ処理費用、郵送料等）は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。

信託財産で有価証券の売買を行なう際に発生する売買委託手数料、当該売買委託手数料にかかる消費税等に相当する金額、信託財産に属する資産を外国で保管する場合の費用は、信託財産中より支弁します。

（ ）「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。

手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。また、上場不動産投資信託は市場価格により取引されており、費用を表示することができません。

#### <マザーファンドより支弁する手数料等>

各マザーファンドの投資対象等に応じて、信託財産に関する租税、有価証券売買時の売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、資産を外国で保管する場合の費用等を支弁します。

#### (5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%

の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

## 八．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

### 法人の投資者に対する課税

法人の投資者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については配当所得として課税され、15%（所得税15%）の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）には課税されません。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）となります。なお、益金不算入制度の適用はありません。

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

### <注1> 個別元本について

投資者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する金額は含まれません。）が当該投資者の元本（個別元本）にあたります。

投資者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該投資者が追加信託を行なうつど当該投資者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。

ただし、個別元本は、複数支店で同一ファンドをお申込みの場合などにより把握方法が異なる場合がありますので、販売会社にお問合わせ下さい。

投資者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該投資者の個別元本となります。

<注2> 収益分配金の課税について

追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（投資者ごとの元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

投資者が収益分配金を受取る際、イ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本と同額の場合または当該投資者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、ロ．当該収益分配金落ち後の基準価額が当該投資者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

- ( ) 2020年1月1日以降の分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- ( ) 上記は、2019年9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。
- ( ) 課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

## 5 【運用状況】

## (1) 【投資状況】 (2019年9月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	631,578,295	99.07
内 日本	631,578,295	99.07
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	5,939,859	0.93
純資産総額	637,518,154	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】 (2019年9月30日現在)

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	ダイワ・REITアクティブ・マザー ファンド	日本	親投資 信託受 益証券	34,685,350	3.1903 110,656,673	3.2894 114,093,990	17.90
2	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	40,366,215	2.5990 104,911,794	2.6386 106,510,294	16.71
3	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	60,908,371	1.6995 103,513,776	1.7043 103,806,136	16.28
4	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	81,004,476	1.2827 103,904,441	1.2803 103,710,030	16.27
5	ダイワ日本ハーモニーストック・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	85,684,316	1.1476 98,331,321	1.1881 101,801,535	15.97
6	ダイワ外国ハーモニーストック・マ ザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	46,573,652	2.2253 103,640,347	2.1827 101,656,310	15.95

(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	99.07%
合計	99.07%

(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8特定期間末 (2010年3月8日)	10,692,248,916	10,745,973,634	0.5971	0.6001
第9特定期間末 (2010年9月6日)	7,798,140,191	7,839,456,750	0.5662	0.5692
第10特定期間末 (2011年3月7日)	5,730,967,463	5,749,873,656	0.6063	0.6083
第11特定期間末 (2011年9月6日)	3,560,134,170	3,573,461,950	0.5342	0.5362
第12特定期間末 (2012年3月6日)	2,726,947,257	2,731,732,476	0.5699	0.5709
第13特定期間末 (2012年9月6日)	2,078,365,006	2,082,077,533	0.5598	0.5608
第14特定期間末 (2013年3月6日)	2,223,686,916	2,226,847,683	0.7035	0.7045
第15特定期間末 (2013年9月6日)	1,965,705,474	1,968,408,487	0.7272	0.7282
第16特定期間末 (2014年3月6日)	1,885,679,377	1,888,027,488	0.8031	0.8041
第17特定期間末 (2014年9月8日)	1,730,255,928	1,732,293,672	0.8491	0.8501

第18特定期間末 (2015年3月6日)	1,448,031,765	1,449,549,957	0.9538	0.9548
第19特定期間末 (2015年9月7日)	1,142,131,200	1,143,425,179	0.8827	0.8837
第20特定期間末 (2016年3月7日)	1,038,896,216	1,040,066,252	0.8879	0.8889
第21特定期間末 (2016年9月6日)	937,974,850	939,047,761	0.8742	0.8752
第22特定期間末 (2017年3月6日)	898,192,319	899,171,681	0.9171	0.9181
第23特定期間末 (2017年9月6日)	794,987,775	795,852,695	0.9191	0.9201
第24特定期間末 (2018年3月6日)	747,130,182	747,931,831	0.9320	0.9330
第25特定期間末 (2018年9月6日)	680,898,712	681,604,088	0.9653	0.9663
2018年9月末日	690,505,904	-	0.9850	-
10月末日	658,517,381	-	0.9392	-
11月末日	667,235,547	-	0.9566	-
12月末日	626,919,466	-	0.9072	-
2019年1月末日	645,490,982	-	0.9378	-
2月末日	653,603,540	-	0.9590	-
第26特定期間末 (2019年3月6日)	655,753,855	656,435,376	0.9622	0.9632
3月末日	654,770,765	-	0.9728	-
4月末日	658,437,746	-	0.9806	-
5月末日	638,240,956	-	0.9526	-
6月末日	643,194,108	-	0.9676	-
7月末日	641,177,168	-	0.9848	-
8月末日	627,615,797	-	0.9762	-
第27特定期間末 (2019年9月6日)	634,628,538	635,271,477	0.9871	0.9881
9月末日	637,518,154	-	0.9965	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第8特定期間	0.0220
第9特定期間	0.0180
第10特定期間	0.0150

第11特定期間	0.0120
第12特定期間	0.0090
第13特定期間	0.0060
第14特定期間	0.0060
第15特定期間	0.0060
第16特定期間	0.0060
第17特定期間	0.0060
第18特定期間	0.0060
第19特定期間	0.0060
第20特定期間	0.0060
第21特定期間	0.0060
第22特定期間	0.0060
第23特定期間	0.0060
第24特定期間	0.0060
第25特定期間	0.0060
第26特定期間	0.0060
第27特定期間	0.0060

(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8特定期間	2.2
第9特定期間	2.2
第10特定期間	9.7
第11特定期間	9.9
第12特定期間	8.4
第13特定期間	0.7
第14特定期間	26.7
第15特定期間	4.2
第16特定期間	11.3
第17特定期間	6.5
第18特定期間	13.0
第19特定期間	6.8
第20特定期間	1.3
第21特定期間	0.9
第22特定期間	5.6
第23特定期間	0.9
第24特定期間	2.1

第25特定期間	4.2
第26特定期間	0.3
第27特定期間	3.2

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第8特定期間	74,873,258	5,117,368,720
第9特定期間	28,038,971	4,164,091,913
第10特定期間	17,489,243	4,336,578,861
第11特定期間	9,176,941	2,798,383,496
第12特定期間	7,129,746	1,885,800,773
第13特定期間	3,288,231	1,075,979,918
第14特定期間	2,642,560	554,402,406
第15特定期間	1,750,484	459,505,224
第16特定期間	1,260,298	356,162,054
第17特定期間	802,846	311,169,491
第18特定期間	2,295,000	521,846,915
第19特定期間	457,336	224,670,617
第20特定期間	418,072	124,361,343
第21特定期間	408,623	97,533,399
第22特定期間	383,746	93,932,413
第23特定期間	357,041	114,799,683
第24特定期間	309,332	63,579,762
第25特定期間	259,333	96,532,324
第26特定期間	364,100	24,219,738
第27特定期間	252,406	38,833,447

(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 (2019年9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	24,943,331,952	94.61
内 ユーロ	6,324,768,867	23.99
内 ノルウェー	489,862,771	1.86
内 スウェーデン	323,800,880	1.23
内 デンマーク	779,202,016	2.96



	内 イギリス	3,117,354,108	11.82
	内 ポーランド	1,805,096,381	6.85
	内 カナダ	2,264,930,616	8.59
	内 アメリカ	6,542,456,931	24.81
	内 オーストラリア	3,295,859,382	12.50
特殊債券		970,626,167	3.68
	内 カナダ	970,626,167	3.68
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		451,554,129	1.71
純資産総額		26,365,512,248	100.00

## その他の資産の投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引(買建)	2,408,719,000	9.14
内 日本	2,408,719,000	9.14
為替予約取引(売建)	2,416,861,531	9.17
内 日本	2,416,861,531	9.17

(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 (2019年9月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 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	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	15,000,000	109.36 1,936,035,486	113.64 2,011,768,920	1.950000 2026/04/30	7.63
2	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債 証券	19,000,000	129.87 1,798,349,711	143.42 1,986,076,201	4.500000 2033/04/21	7.53
3	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	15,000,000	95.10 1,539,494,988	100.10 1,620,564,492	1.625000 2026/02/15	6.15
4	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	15,000,000	98.99 1,602,482,496	99.48 1,610,446,992	1.375000 2021/04/30	6.11
5	United Kingdom Gilt	イギリス	国債 証券	9,300,000	123.81 1,527,848,787	125.41 1,547,580,719	5.000000 2025/03/07	5.87

6	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	13,100,000	94.61 1,337,586,728	107.67 1,522,200,915	2.500000 2046/02/15	5.77
7	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	10,000,000	104.31 1,231,090,224	111.62 1,317,386,448	1.400000 2028/04/30	5.00
8	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	42,000,000	110.15 1,246,381,794	108.64 1,229,307,760	5.750000 2021/10/25	4.66
9	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	13,500,000	98.85 1,087,474,678	100.87 1,109,741,006	1.500000 2026/06/01	4.21
10	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,200,000	146.05 896,345,377	170.79 1,048,145,061	3.250000 2045/05/25	3.98
11	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	11,500,000	103.58 970,712,547	104.75 981,648,912	2.250000 2025/06/01	3.72
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	99.14 855,935,104	103.75 895,736,000	2.250000 2025/11/15	3.40
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	100.44 867,238,375	103.49 893,508,531	2.375000 2024/02/29	3.39
14	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	6,600,000	105.82 824,312,578	108.59 845,888,994	1.000000 2026/05/15	3.21
15	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	4,500,000	104.00 621,042,939	108.16 645,870,565	1.500000 2026/07/22	2.45
16	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	33,000,000	113.66 593,040,056	115.67 603,526,829	1.750000 2025/11/15	2.29
17	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	7,000,000	101.19 577,235,229	103.05 587,833,819	2.250000 2025/12/15	2.23
18	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	20,000,000	99.10 533,988,516	106.86 575,788,620	2.750000 2029/10/25	2.18
19	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	5,700,000	122.07 507,102,465	128.39 533,377,527	4.750000 2027/04/21	2.02
20	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	7,000,000	102.40 522,429,348	102.01 520,449,927	4.500000 2020/04/15	1.97
21	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	3,600,000	107.75 457,829,321	110.96 471,467,712	1.100000 2029/05/15	1.79

22	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,200,000	103.68 440,267,543	110.67 469,917,919	1.625000 2028/10/22	1.78
23	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	4,500,000	102.99 377,669,479	104.38 382,792,348	2.550000 2025/03/15	1.45
24	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,500,000	153.78 272,250,896	183.17 324,278,243	3.750000 2045/06/22	1.23
25	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	27,000,000	108.07 321,572,305	108.82 323,800,880	1.500000 2023/11/13	1.23
26	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	1,500,000	148.14 262,255,782	172.75 305,833,487	2.500000 2046/08/15	1.16
27	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	2,900,000	116.31 245,840,419	121.10 255,955,726	3.250000 2029/04/21	0.97
28	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	107.33 255,027,960	107.53 255,496,032	3.000000 2024/03/14	0.97
29	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,000,000	157.72 209,278,668	178.68 237,090,492	4.250000 2046/12/07	0.90
30	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,500,000	109.52 218,001,045	108.97 216,894,410	4.000000 2022/03/07	0.82

(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	94.61%
特殊債券	3.68%
合計	98.29%

(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 2019年10月	買建	28,200,000	2,048,185,151	2,053,806,000	7.79%
		ノルウェー・クローネ買/円売 2019年10月	買建	29,900,000	355,008,210	354,913,000	1.35%
		カナダ・ドル売/円買 2019年10月	売建	25,342,553	2,048,185,151	2,063,137,257	7.83%
		スウェーデン・クローネ売/円買 2019年10月	売建	32,098,392	355,008,210	353,724,274	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 (2019年9月30日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	217,291,254,090	98.97
内 日本	217,291,254,090	98.97
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,269,890,544	1.03
純資産総額	219,561,144,634	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 (2019年9月30日現在)

##### 投資有価証券の主要銘柄

##### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 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	12 30年国債	日本	国債証券	11,400,000,000	127.54 14,539,560,000	129.69 14,785,686,000	2.100000 2033/09/20	6.73
2	1 30年国債	日本	国債証券	11,250,000,000	129.26 14,542,602,000	130.25 14,653,462,500	2.800000 2029/09/20	6.67

3	4	30年国債	日本	国債証券	10,900,000,000	133.20 14,519,682,000	134.24 14,632,160,000	2.900000 2030/11/20	6.66
4	48	20年国債	日本	国債証券	14,101,000,000	104.73 14,768,172,300	103.44 14,586,074,400	2.500000 2020/12/21	6.64
5	54	20年国債	日本	国債証券	13,687,000,000	106.56 14,585,410,680	105.64 14,459,494,280	2.200000 2021/12/20	6.59
6	95	20年国債	日本	国債証券	11,805,000,000	120.47 14,222,523,000	120.82 14,263,745,400	2.300000 2027/06/20	6.50
7	2	30年国債	日本	国債証券	11,200,000,000	127.35 14,264,096,000	127.17 14,244,048,000	2.400000 2030/02/20	6.49
8	6	30年国債	日本	国債証券	10,850,000,000	129.07 14,004,095,000	130.55 14,165,109,000	2.400000 2031/11/20	6.45
9	64	20年国債	日本	国債証券	12,400,000,000	109.06 13,524,184,000	109.05 13,523,192,000	1.900000 2023/09/20	6.16
10	70	20年国債	日本	国債証券	10,438,000,000	113.58 11,856,106,680	113.19 11,814,876,580	2.400000 2024/06/20	5.38
11	86	20年国債	日本	国債証券	6,300,000,000	117.38 7,395,290,400	117.49 7,401,996,000	2.300000 2026/03/20	3.37
12	80	20年国債	日本	国債証券	6,473,000,000	114.28 7,397,344,400	114.26 7,396,114,530	2.100000 2025/06/20	3.37
13	101	20年国債	日本	国債証券	5,960,000,000	122.53 7,302,788,000	123.39 7,354,580,400	2.400000 2028/03/20	3.35
14	16	30年国債	日本	国債証券	5,300,000,000	137.34 7,279,126,000	137.01 7,261,742,000	2.500000 2034/09/20	3.31
15	75	20年国債	日本	国債証券	6,374,000,000	113.71 7,248,183,000	113.62 7,242,138,800	2.100000 2025/03/20	3.30
16	102	20年国債	日本	国債証券	5,800,000,000	123.26 7,149,080,000	123.94 7,188,984,000	2.400000 2028/06/20	3.27
17	88	20年国債	日本	国債証券	6,060,000,000	118.10 7,157,226,000	118.19 7,162,314,000	2.300000 2026/06/20	3.26
18	15	30年国債	日本	国債証券	5,200,000,000	136.88 7,118,072,000	136.59 7,102,836,000	2.500000 2034/06/20	3.24
19	44	20年国債	日本	国債証券	5,100,000,000	101.59 5,181,530,000	101.31 5,166,861,000	2.500000 2020/03/20	2.35
20	306	10年国債	日本	国債証券	4,400,000,000	100.82 4,436,300,000	100.79 4,434,980,000	1.400000 2020/03/20	2.02
21	307	10年国債	日本	国債証券	4,400,000,000	100.77 4,434,188,000	100.74 4,432,912,000	1.300000 2020/03/20	2.02
22	68	20年国債	日本	国債証券	2,725,000,000	111.91 3,049,547,500	111.54 3,039,546,750	2.200000 2024/03/20	1.38

23	59 20年国債	日本	国債証券	795,000,000	107.06 851,155,000	106.69 848,193,450	1.700000 2022/12/20	0.39
24	7 30年国債	日本	国債証券	100,000,000	128.55 128,550,000	130.20 130,207,000	2.300000 2032/05/20	0.06

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	98.97%
合計	98.97%

(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。

#### ダイワ外国ハーモニーストック・マザーファンド

#### (1) 投資状況 (2019年9月30日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		1,384,028,531	99.55
	内 中国	55,010,554	3.96
	内 香港	7,534,976	0.54
	内 ノルウェー	828,511	0.06
	内 デンマーク	11,031,744	0.79
	内 イギリス	40,947,929	2.95
	内 オランダ	31,752,964	2.28
	内 ベルギー	3,349,408	0.24
	内 フランス	34,998,389	2.52
	内 ドイツ	20,845,402	1.50
	内 スイス	36,104,826	2.60

内 イタリア	4,324,772	0.31
内 カナダ	11,139,846	0.80
内 アメリカ	1,124,831,470	80.90
内 オーストラリア	1,327,740	0.10
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,307,940	0.45
純資産総額	1,390,336,471	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 (2019年9月30日現在)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	5,300	15,111.71 80,092,111	14,863.82 78,778,254	5.67
2	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	2,900	23,155.85 67,152,268	23,615.05 68,483,658	4.93
3	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	470	131,403.28 61,759,561	132,211.71 62,139,505	4.47
4	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	2,750	12,398.92 34,097,203	12,704.34 34,936,942	2.51
5	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	180	198,650.50 35,757,090	186,210.56 33,517,902	2.41
6	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	21,500	1,286.29 27,655,506	1,236.33 26,581,224	1.91
7	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	1,350	19,896.56 26,860,484	18,778.08 25,350,408	1.82
8	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	800	31,425.11 25,140,167	29,044.50 23,235,608	1.67
9	FACEBOOK INC-CLASS A	アメリカ	株式	コミュニケーション・サービス	1,175	20,601.92 24,207,265	19,112.63 22,457,343	1.62

10	TENCENT HOLDINGS LTD	中国	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	4,400	4,759.90 20,943,620	4,532.54 19,943,194	1.43
11	PROCTER & GAMBLE CO/THE	アメリカ	株式	生活必 需品	1,400	13,248.25 18,547,563	13,443.59 18,821,032	1.35
12	WALT DISNEY CO/THE	アメリカ	株式	コミュニ ケーショ ン・サー ビス	1,100	14,983.61 16,481,974	14,025.28 15,427,812	1.11
13	INTEL CORP	アメリカ	株式	情報技 術	2,800	5,499.27 15,398,124	5,480.17 15,344,497	1.10
14	BOEING CO/THE	アメリカ	株式	資本財・ サービ ス	350	39,936.76 13,977,892	41,318.25 14,461,388	1.04
15	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消 費財・ サービ ス	575	24,621.94 14,157,620	24,806.49 14,263,732	1.03
16	NESTLE SA-REG	スイス	株式	生活必 需品	1,200	12,183.67 14,620,406	11,726.37 14,071,651	1.01
17	ASML HOLDING NV	オランダ	株式	情報技 術	500	25,386.10 12,693,051	26,607.60 13,303,805	0.96
18	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	株式	金融	4,200	3,124.71 13,123,947	3,167.45 13,303,298	0.96
19	WALMART INC	アメリカ	株式	生活必 需品	1,000	12,458.28 12,458,285	12,783.12 12,783,124	0.92
20	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技 術	750	16,594.85 12,446,144	16,000.21 12,000,164	0.86
21	COCA-COLA CO/THE	アメリカ	株式	生活必 需品	2,000	5,948.55 11,897,101	5,861.13 11,722,270	0.84
22	MEDTRONIC PLC	アメリカ	株式	ヘルス ケア	1,000	11,625.14 11,625,142	11,581.97 11,581,974	0.83
23	NEXTERA ENERGY INC	アメリカ	株式	公益事 業	450	23,721.89 10,674,853	24,957.57 11,230,911	0.81
24	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	スイス	株式	ヘルス ケア	350	30,189.37 10,566,315	31,422.76 10,997,969	0.79
25	PEPSICO INC	アメリカ	株式	生活必 需品	750	14,674.96 11,006,221	14,633.95 10,975,464	0.79



26	ABBOTT LABORATORIES	アメリカ	株式	ヘルス ケア	1,200	9,270.32 11,124,394	8,832.17 10,598,607	0.76
27	LOCKHEED MARTIN CORP	アメリカ	株式	資本財・ サービス	250	41,565.38 10,391,347	41,858.93 10,464,733	0.75
28	STRYKER CORP	アメリカ	株式	ヘルス ケア	450	23,766.14 10,694,764	23,052.79 10,373,756	0.75
29	MCDONALD'S CORP	アメリカ	株式	一般消 費財・ サービス	450	23,687.36 10,659,312	23,004.22 10,351,902	0.74
30	US BANCORP	アメリカ	株式	金融	1,700	6,005.53 10,209,481	5,982.00 10,169,410	0.73

(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	99.55%
合計	99.55%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
エネルギー	1.94%
素材	0.71%
資本財・サービス	9.97%
一般消費財・サービス	10.40%
生活必需品	7.34%
ヘルスケア	12.06%
金融	13.08%
情報技術	30.03%
コミュニケーション・サービス	10.82%
公益事業	3.21%
合計	99.55%

(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。

## ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド

## (1) 投資状況（2019年9月30日現在）

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,342,252,800	93.49
内 日本	1,342,252,800	93.49
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	93,471,947	6.51
純資産総額	1,435,724,747	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（2019年9月30日現在）

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

銘柄名	地域	種類	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 ソニー	日本	株式	電気機器	12,000	6,360.00 76,320,000	6,347.00 76,164,000	5.30
2 東京海上HD	日本	株式	保険業	11,000	5,567.00 61,237,000	5,779.00 63,569,000	4.43
3 ダイセキ	日本	株式	サービス業	21,000	2,640.30 55,446,342	2,759.00 57,939,000	4.04
4 ビジョン	日本	株式	その他製品	12,200	4,200.00 51,240,000	4,455.00 54,351,000	3.79
5 AGC	日本	株式	ガラス・土石製品	16,000	3,195.33 51,125,349	3,350.00 53,600,000	3.73
6 三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	97,000	519.80 50,420,600	548.40 53,194,800	3.71
7 明電舎	日本	株式	電気機器	27,000	1,755.00 47,385,000	1,853.00 50,031,000	3.48

8	五洋建設	日本	株式	建設業	80,000	572.90 45,832,338	598.00 47,840,000	3.33
9	第一三共	日本	株式	医薬品	7,000	7,048.00 49,336,000	6,804.00 47,628,000	3.32
10	野村総合研究所	日本	株式	情報・通 信業	22,000	2,180.00 47,960,000	2,151.00 47,322,000	3.30
11	ワコールホールディングス	日本	株式	繊維製 品	17,000	2,529.00 42,993,000	2,777.00 47,209,000	3.29
12	東京エレクトロン	日本	株式	電気機 器	2,200	20,005.00 44,011,000	20,565.00 45,243,000	3.15
13	キヤノンマーケティングJPN	日本	株式	卸売業	19,000	2,140.00 40,660,000	2,294.00 43,586,000	3.04
14	NTTデータ	日本	株式	情報・通 信業	30,000	1,380.50 41,415,264	1,394.00 41,820,000	2.91
15	日本特殊陶業	日本	株式	ガラス・ 土石製 品	20,000	1,877.00 37,540,000	2,058.00 41,160,000	2.87
16	カゴメ	日本	株式	食料品	15,000	2,715.00 40,725,000	2,729.00 40,935,000	2.85
17	ダイキン工業	日本	株式	機械	2,800	14,075.00 39,410,000	14,180.00 39,704,000	2.77
18	信越化学	日本	株式	化学	3,400	11,170.00 37,978,000	11,560.00 39,304,000	2.74
19	日本電産	日本	株式	電気機 器	2,700	13,975.00 37,732,500	14,520.00 39,204,000	2.73
20	ディスコ	日本	株式	機械	1,900	20,840.00 39,596,000	20,460.00 38,874,000	2.71
21	オリエンタルランド	日本	株式	サービ ス業	2,300	15,970.00 36,731,000	16,440.00 37,812,000	2.63
22	参天製薬	日本	株式	医薬品	16,800	1,793.00 30,122,400	1,878.00 31,550,400	2.20
23	デンソー	日本	株式	輸送用 機器	6,200	4,596.00 28,495,200	4,749.00 29,443,800	2.05
24	コクヨ	日本	株式	その他製 品	17,500	1,396.00 24,430,000	1,508.00 26,390,000	1.84
25	ヤマハ	日本	株式	その他製 品	5,000	4,615.00 23,075,000	4,850.00 24,250,000	1.69
26	東急不動産HD	日本	株式	不動産 業	33,600	661.00 22,209,600	689.00 23,150,400	1.61

27	森永乳業	日本	株式	食料品	5,100	4,380.00 22,338,000	4,120.00 21,012,000	1.46
28	電通	日本	株式	サービス業	5,400	3,650.00 19,710,000	3,805.00 20,547,000	1.43
29	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	6,000	3,255.00 19,530,000	3,286.00 19,716,000	1.37
30	三井化学	日本	株式	化学	8,000	2,301.00 18,408,000	2,416.00 19,328,000	1.35

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	93.49%
合計	93.49%

(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	3.33%
食料品	5.64%
繊維製品	3.29%
化学	4.08%
医薬品	5.51%
ガラス・土石製品	6.60%
機械	6.75%
電気機器	14.67%
輸送用機器	2.05%
その他製品	8.43%
情報・通信業	7.01%
卸売業	3.04%
小売業	2.67%
銀行業	3.71%
保険業	4.43%
不動産業	1.61%
サービス業	10.67%
合計	93.49%

(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・グローバルREIT・マザーファンド

(1) 投資状況 (2019年9月30日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	87,891,783,367	95.46
内 香港	4,240,786,702	4.61
内 シンガポール	5,779,964,177	6.28
内 イギリス	7,162,376,663	7.78
内 オランダ	276,099,399	0.30
内 ベルギー	1,759,846,803	1.91
内 フランス	6,577,806,591	7.14
内 ドイツ	724,055,482	0.79
内 スペイン	1,403,669,567	1.52
内 カナダ	3,206,160,593	3.48
内 アメリカ	45,896,508,109	49.85
内 オーストラリア	9,833,751,885	10.68
内 ニューージーランド	1,030,757,396	1.12
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,184,193,790	4.54
純資産総額	92,075,977,157	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)	187,763,623	0.20
内 日本	187,763,623	0.20
為替予約取引(売建)	187,850,278	0.20
内 日本	187,850,278	0.20

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

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

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

(2) 投資資産 (2019年9月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	LINK REIT	香港	投資証券	3,526,305	1,223.26 4,313,601,960	1,177.85 4,153,479,502	4.51
2	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	377,530	9,381.48 3,541,792,259	9,744.09 3,678,688,865	4.00
3	UDR INC	アメリカ	投資証券	686,757	5,198.50 3,570,110,660	5,215.77 3,581,969,030	3.89
4	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	94,697	34,998.45 3,314,248,788	35,219.69 3,335,199,173	3.62
5	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	325,005	9,196.94 2,989,052,265	9,257.37 3,008,694,007	3.27
6	KLEPIERRE	フランス	投資証券	827,069	3,527.61 2,917,583,326	3,636.19 3,007,385,155	3.27
7	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	2,679,989	988.90 2,650,432,521	1,023.96 2,744,212,256	2.98
8	EQUINIX INC	アメリカ	投資証券	41,437	60,831.69 2,520,684,285	62,228.83 2,578,576,045	2.80
9	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	10,322,741	221.55 2,287,056,947	224.47 2,317,149,801	2.52
10	REALTY INCOME CORP	アメリカ	投資証券	273,424	8,023.20 2,193,751,930	8,323.86 2,275,945,722	2.47
11	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	710,649	3,042.26 2,161,982,438	3,195.51 2,270,886,839	2.47
12	COVIVIO	フランス	投資証券	187,216	11,093.88 2,076,951,838	11,388.93 2,132,189,919	2.32
13	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	107,314	16,683.24 1,790,351,293	17,047.04 1,829,386,394	1.99
14	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	1,657,433	1,014.01 1,680,665,204	1,070.01 1,773,473,464	1.93
15	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	カナダ	投資証券	403,368	4,258.66 1,717,810,152	4,358.90 1,758,240,816	1.91
16	KEPPEL DC REIT	シンガポール	投資証券	11,717,413	138.98 1,628,614,858	148.35 1,738,301,653	1.89
17	PUBLIC STORAGE	アメリカ	投資証券	65,555	26,694.01 1,749,925,957	26,441.47 1,733,371,169	1.88

18	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	137,079	12,639.59 1,732,622,412	12,593.18 1,726,261,179	1.87
19	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	1,978,019	806.05 1,594,387,753	843.95 1,669,349,926	1.81
20	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	673,625	2,385.03 1,606,617,181	2,429.27 1,636,423,201	1.78
21	CYRUSONE INC	アメリカ	投資証券	188,705	8,070.25 1,522,897,960	8,377.82 1,580,938,335	1.72
22	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	98,083	15,870.71 1,556,647,359	16,002.37 1,569,561,202	1.70
23	NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア	投資証券	11,895,590	130.45 1,551,841,573	130.81 1,556,176,326	1.69
24	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	5,400,713	284.96 1,538,991,497	286.41 1,546,863,576	1.68
25	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	6,252,477	237.36 1,484,107,949	244.39 1,528,045,355	1.66
26	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	カナダ	投資証券	397,407	3,573.33 1,420,068,938	3,643.41 1,447,919,777	1.57
27	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	186,255	7,363.38 1,371,466,640	7,455.11 1,388,552,184	1.51
28	KILROY REALTY CORP	アメリカ	投資証券	162,911	8,306.60 1,353,236,904	8,369.19 1,363,434,090	1.48
29	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	イギリス	投資証券	4,662,530	280.24 1,307,032,598	288.46 1,344,990,984	1.46
30	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	シンガポール	投資証券	7,053,835	183.40 1,293,801,094	188.95 1,332,847,517	1.45

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	95.46%
合計	95.46%

(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

(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	ニュージーランド・ドル 買/円売 2019年10月	買建	226,108	15,390,048	15,309,746	0.02%
		米ドル買/円売 2019年10 月	買建	1,598,139	172,478,779	172,453,877	0.19%
		香港ドル売/円買 2019年 10月	売建	1,018,105	14,009,122	13,998,941	0.02%
		英ポンド売/円買 2019年 10月	売建	694,244	92,119,181	92,112,239	0.10%
		米ドル売/円買 2019年10 月	売建	142,606	15,390,048	15,388,622	0.02%
		ユーロ売/円買 2019年10 月	売建	562,197	66,350,476	66,350,476	0.07%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

## ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

## (1) 投資状況 (2019年9月30日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	124,210,721,940	97.90
内 日本	124,210,721,940	97.90
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	2,661,316,248	2.10
純資産総額	126,872,038,188	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 (2019年9月30日現在)

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ. 主要銘柄の明細



	銘柄名	地域	種類	株数、口数 また は 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	14,366	616,415.68 8,855,427,712	725,000.00 10,415,350,000	8.21
2	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	25,236	254,698.15 6,427,562,629	304,000.00 7,671,744,000	6.05
3	日本ビルファンド	日本	投資証券	9,057	730,808.49 6,618,932,503	830,000.00 7,517,310,000	5.93
4	野村不動産マスターF	日本	投資証券	37,128	164,003.79 6,089,132,821	195,200.00 7,247,385,600	5.71
5	森ヒルズリート	日本	投資証券	30,348	150,452.71 4,565,938,894	171,600.00 5,207,716,800	4.10
6	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	5,995	754,919.30 4,525,741,216	854,000.00 5,119,730,000	4.04
7	日本プロロジスリート	日本	投資証券	17,154	241,459.57 4,141,997,662	296,100.00 5,079,299,400	4.00
8	日本リテールファンド	日本	投資証券	20,530	212,048.91 4,353,364,227	228,600.00 4,693,158,000	3.70
9	オリックス不動産投資	日本	投資証券	18,344	195,131.77 3,579,497,289	236,000.00 4,329,184,000	3.41
10	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	42,818	82,231.56 3,520,991,296	96,900.00 4,149,064,200	3.27
11	API投資法人	日本	投資証券	7,240	469,610.40 3,399,979,364	552,000.00 3,996,480,000	3.15
12	インベスコ・オフィス・リート	日本	投資証券	168,036	17,065.68 2,867,650,234	21,490.00 3,611,093,640	2.85
13	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	50,615	56,589.04 2,864,254,596	66,700.00 3,376,020,500	2.66
14	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	9,343	314,864.13 2,941,775,649	355,000.00 3,316,765,000	2.61
15	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	13,322	181,943.02 2,423,845,042	213,200.00 2,840,250,400	2.24
16	星野リゾート・リート	日本	投資証券	4,316	535,563.64 2,311,492,690	596,000.00 2,572,336,000	2.03
17	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	5,002	447,500.00 2,238,395,000	513,000.00 2,566,026,000	2.02
18	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	11,517	178,800.00 2,059,239,600	207,000.00 2,384,019,000	1.88

19	森トラスト総合リート	日本	投資証券	12,151	169,190.57 2,055,834,639	193,800.00 2,354,863,800	1.86
20	GLP投資法人	日本	投資証券	15,865	123,183.01 1,954,298,612	143,400.00 2,275,041,000	1.79
21	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	14,563	122,386.72 1,782,317,859	154,800.00 2,254,352,400	1.78
22	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,580	759,000.00 1,958,220,000	839,000.00 2,164,620,000	1.71
23	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	21,710	86,146.49 1,870,240,350	99,500.00 2,160,145,000	1.70
24	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	26,396	88,800.00 2,343,964,800	80,600.00 2,127,517,600	1.68
25	福岡リート投資法人	日本	投資証券	11,510	172,105.69 1,980,936,560	183,700.00 2,114,387,000	1.67
26	三井不ロジパーク	日本	投資証券	4,289	359,431.07 1,541,599,898	450,500.00 1,932,194,500	1.52
27	産業ファンド	日本	投資証券	11,933	130,031.59 1,551,667,075	155,200.00 1,852,001,600	1.46
28	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	5,290	300,507.56 1,589,685,007	347,000.00 1,835,630,000	1.45
29	MCUBS MidCity投資法人	日本	投資証券	13,061	103,490.70 1,351,692,104	118,700.00 1,550,340,700	1.22
30	いちごオフィスリート投資法人	日本	投資証券	13,079	104,067.74 1,361,101,994	112,500.00 1,471,387,500	1.16

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	97.90%
合計	97.90%

(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。

## （参考情報）運用実績

### ●世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)

2019年9月30日現在

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

#### 基準価額・純資産の推移

基準価額	9,965円
純資産総額	6.3億円



基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	2.2%
3カ月間	3.3%
6カ月間	3.1%
1年間	2.4%
3年間	20.8%
5年間	24.0%
設定来	68.2%

※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: 120円 設定来分配金合計額: 4,185円

決算期	第148期	第149期	第150期	第151期	第152期	第153期	第154期	第155期	第156期	第157期	第158期	第159期
	18年10月	18年11月	18年12月	19年1月	19年2月	19年3月	19年4月	19年5月	19年6月	19年7月	19年8月	19年9月
分配金	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円	10円

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

#### 主要な資産の状況

※比率は、純資産総額に対するものです。

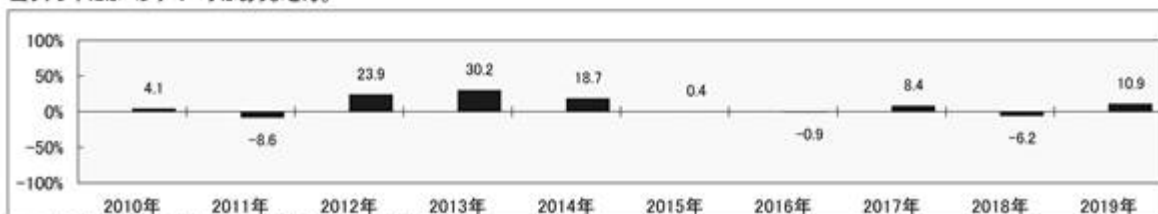
資産別構成		銘柄数		比率		通貨別構成		比率		債券ポートフォリオ特性値		組入上位銘柄		国・地域名		比率	
国内リート	50	17.5%	日本円	51.2%	直接利回り(%)	2.1	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.9%								
国内債券	24	16.1%	米ドル	26.0%	最終利回り(%)	0.3	ソニー	日本	0.8%								
外国債券	34	16.0%	ユーロ	6.9%	修正デュレーション	7.3	APPLE INC	アメリカ	0.8%								
外国リート	69	15.9%	豪ドル	5.2%	残存年数	8.4	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	0.7%								
外国株式	189	15.9%	英ポンド	3.8%	債券格付別構成	比率	東京海上HD	日本	0.7%								
国内株式	37	14.9%	香港ドル	1.5%	AAA	87.6%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.5%								
			カナダ・ドル	1.5%	AA	6.4%	大和ハウスリート投資法人	日本	1.1%								
			ポーランド・ズロチ	1.2%	A	6.0%	日本ビルファンド	日本	1.1%								
			シンガポール・ドル	1.1%	BBB	-	野村不動産マスターF	日本	1.0%								
コール・ローン、その他	3.6%		その他	1.7%	BB	-	LINK REIT	香港	0.8%								
合計	403	100.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	9.3%									

※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

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

#### 年間収益率の推移

当ファンドにはベンチマークはありません。



※ファンドの「年間収益率」は、「分配金再投資基準価額」の騰落率です。

※2019年は9月30日までの騰落率を表しています。

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



## 第2 【管理及び運営】

### 1 【申込(販売)手続等】

受益権の取得申込者は、販売会社において取引口座を開設のうえ、取得の申込みを行なうものとします。

当ファンドには、収益分配金を税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資する「分配金再投資コース」と、収益の分配が行なわれるごとに収益分配金を受益者に支払う「分配金支払いコース」があります。

「分配金再投資コース」を利用する場合、取得申込者は、販売会社と別に定める積立投資約款にしたがい契約（以下「別に定める契約」といいます。）を締結します。

販売会社は、受益権の取得申込者に対し、最低単位を1円単位または1口単位として販売会社が定める単位をもって、取得の申込みに応じることができます。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

お買付時の申込手数料については、販売会社が別に定めるものとします。申込手数料には、消費税等が課されます。なお、「分配金再投資コース」の収益分配金の再投資の際には、申込手数料はかかりません。

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた取得の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された当ファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行ないます。

### 2 【換金(解約)手続等】

委託会社の各営業日の午後3時までに受付けた換金の申込み（当該申込みにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを）、当日の受付分として取扱います。この時刻を過ぎて行なわれる申込みは、翌営業日の取扱いとなります。

なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうために大口の解約請求には制限があります。

#### <一部解約>

受益者は、自己に帰属する受益権について、最低単位を1口単位として販売会社が定める単位をもって、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）  
電話番号（コールセンター） 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00）
- ・委託会社のホームページ  
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することができます。一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回することができます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該振替受益権の解約価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、当該計算日の翌営業日の基準価額とします。

一部解約金は、販売会社の営業所等において、原則として一部解約の実行の請求受付日から起算して5営業日目から受益者に支払います。

受託会社は、一部解約金について、受益者への支払開始日までに、その全額を委託会社の指定する預金口座等に払込みます。受託会社は、委託会社の指定する預金口座等に一部解約金を払込んだ後は、受益者に対する支払いにつき、その責に任じません。

一部解約の実行の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行なうのと引換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

### 3 【資産管理等の概要】

#### (1) 【資産の評価】

基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した1万口当たりの価額をいいます。

純資産総額とは、信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価（注1、注2）により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（注1）当ファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

（注2）マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・わが国の金融商品取引所上場株式：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外の金融商品取引所上場の株式：原則として当該取引所における計算時に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・海外の店頭登録の株式：原則として海外店頭市場における計算時に知り得る直近の日の最終相場または最終買気配相場で評価します。
- ・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・公社債等：原則として次の1.～3.に掲げるいずれかの価額で評価します。
  1. 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値)、
  2. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く。)、
  3. 価格情報会社の提供する価額

なお、外貨建資産(外国通貨表示の有価証券(以下「外貨建有価証券」といいます。))、預金その他の資産をいいます。以下同じ。)の円換算については、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算します。また、予約為替の評価は、原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

- ・お電話によるお問合わせ先(委託会社)  
電話番号(コールセンター) 0120-106212  
(営業日の9:00～17:00)
- ・委託会社のホームページ  
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

## (2) 【保管】

該当事項はありません。

## (3) 【信託期間】

無期限とします。ただし、(5) により信託契約を解約し、信託を終了させることがあります。

## (4) 【計算期間】

毎月7日から翌月6日までとします。ただし、第1計算期間は、2006年6月28日から2006年7月6日までとします。

上記にかかわらず、上記により各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日の場合には、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日から次の計算期間が開始されるものとします。

## (5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意

のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届出ます。

2. 委託会社は、前1.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託契約の解約をしません。
5. 委託会社は、信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 前3.から前5.までの規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前3.の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行なうことが困難な場合には適用しません。
7. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
8. 委託会社が監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、の4.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
9. 受託会社が辞任した場合または裁判所が受託会社を解任した場合において、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更

1. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届出ます。
2. 委託会社は、前1.の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
3. 前2.の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
4. 前3.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、前1.の信託約款の変更をしません。
5. 委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を信託約款にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託約款にかかるすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
6. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、前1.から前5.までの規定にしたがいます。



### 反対者の買取請求権

前 の1.から6.までの規定にしたがい信託契約の解約を行なう場合または前 の規定にしたがい信託約款の変更を行なう場合において、前 の3.または前 の3.の一定の期間内に委託会社に対して異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

### 運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を毎年3月および9月の計算期末に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
  - ・委託会社のホームページ  
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

### 公告

1. 委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。  
<https://www.daiwa-am.co.jp/>
2. 前1.の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

### 関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結される受益権の募集・販売の取扱い等に関する契約は、期間満了の1か月（または3か月）前までに、委託会社および販売会社いずれからも何ら意思の表示のないときは、自動的に1年間更新されるものとし、自動延長後の取扱いについてもこれと同様とします。

## 4 【受益者の権利等】

信託契約締結当初および追加信託当初の受益者は、委託会社の指定する受益権取得申込者とし、分割された受益権は、その取得申込口数に応じて、取得申込者に帰属します。

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

#### 収益分配金および償還金にかかる請求権

受益者は、収益分配金（分配金額は、委託会社が決定します。）および償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権口数で除した額をいいます。以下同じ。）を持分に依りて請求する権利を有します。

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社

の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払います。

上記にかかわらず、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する受益者については、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金が再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

償還金は、信託終了日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(信託終了日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該信託終了日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に、原則として信託終了日から起算して5営業日までに支払います。

収益分配金および償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行なうものとします。

受益者が、収益分配金については支払開始日から5年間その支払いを請求しないときならびに信託終了による償還金については支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

#### 換金請求権

受益者は、保有する受益権を換金する権利を有します。権利行使の方法等については、「2 換金(解約)手続等」をご参照下さい。

### 第3 【ファンドの経理状況】

(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(2019年3月7日から2019年9月6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】

世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前 期 2019年3月6日現在	当 期 2019年9月6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	8,216,555	7,115,816
親投資信託受益証券	648,951,595	628,931,722
流動資産合計	657,168,150	636,047,538
資産合計	657,168,150	636,047,538
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	681,521	642,939
未払受託者報酬	26,958	28,596
未払委託者報酬	679,542	720,770
その他未払費用	26,274	26,695
流動負債合計	1,414,295	1,419,000
負債合計	1,414,295	1,419,000
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 681,521,017	1 642,939,976
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2 25,767,162	2 8,311,438
(分配準備積立金)	22,348,424	22,820,054
元本等合計	655,753,855	634,628,538
純資産合計	655,753,855	634,628,538
負債純資産合計	657,168,150	636,047,538

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期 自 2018年9月7日 至 2019年3月6日	当 期 自 2019年3月7日 至 2019年9月6日
営業収益		
有価証券売買等損益	6,222,299	24,980,127
営業収益合計	6,222,299	24,980,127
営業費用		
支払利息	2,381	2,087
受託者報酬	175,640	175,279
委託者報酬	1 4,427,400	1 4,418,226
その他費用	26,543	26,734
営業費用合計	4,631,964	4,622,326
営業利益	1,590,335	20,357,801
経常利益	1,590,335	20,357,801
当期純利益	1,590,335	20,357,801
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	56,784	159,704
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	24,477,943	25,767,162
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,354,359	1,237,136
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,354,359	1,237,136
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,636	8,166
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,636	8,166
分配金	2 4,155,493	2 3,971,343
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	25,767,162	8,311,438

## (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 2019年3月7日	至 2019年9月6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
	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
1. 1 期首元本額	705,376,655円	681,521,017円
期中追加設定元本額	364,100円	252,406円
期中一部解約元本額	24,219,738円	38,833,447円
2. 特定期間末日における受益権の総数	681,521,017口	642,939,976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25,767,162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8,311,438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 2018年9月7日 至 2019年3月6日	自 2019年3月7日 至 2019年9月6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	267,833円	273,829円

## 2. 2 分配金の計算過程

(自2018年9月7日 至2018年10月9日)

計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(1,243,600円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,835,210円)及び分配準備積立金(22,048,967円)より分配対象額は27,127,777円(1万口当たり386.99円)であり、うち701,001円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2018年10月10日 至2018年11月6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(261,784円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,830,427円)及び分配準備積立金(22,530,071円)より分配対象額は26,622,282円(1万口当たり380.73円)であり、うち699,239円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2019年3月7日 至2019年4月8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(2,245,499円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,688,783円)及び分配準備積立金(22,039,112円)より分配対象額は27,973,394円(1万口当たり416.19円)であり、うち672,130円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自2019年4月9日 至2019年5月7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(242,111円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(3,686,818円)及び分配準備積立金(23,588,807円)より分配対象額は27,517,736円(1万口当たり409.80円)であり、うち671,498円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

<p>（自2018年11月7日 至2018年12月6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（344,071円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,810,821円）及び分配準備積立金（21,970,310円）より分配対象額は26,125,202円（1万口当たり375.68円）であり、うち695,411円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2018年12月7日 至2019年1月7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（836,047円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,788,496円）及び分配準備積立金（21,483,026円）より分配対象額は26,107,569円（1万口当たり377.78円）であり、うち691,082円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2019年5月8日 至2019年6月6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（397,289円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,674,334円）及び分配準備積立金（23,070,316円）より分配対象額は27,141,939円（1万口当たり405.74円）であり、うち668,957円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p> <p>（自2019年6月7日 至2019年7月8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（1,369,561円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,652,649円）及び分配準備積立金（22,653,434円）より分配対象額は27,675,644円（1万口当たり416.34円）であり、うち664,739円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>
--	---



<p>（自2019年1月8日 至2019年2月6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（867,749円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,768,860円）及び分配準備積立金（21,506,308円）より分配対象額は26,142,917円（1万口当たり380.40円）であり、うち687,239円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2019年7月9日 至2019年8月6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（146,621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（3,579,006円）及び分配準備積立金（22,876,911円）より分配対象額は26,602,538円（1万口当たり408.59円）であり、うち651,080円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>
<p>（自2019年2月7日 至2019年3月6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（1,524,920円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,738,854円）及び分配準備積立金（21,505,025円）より分配対象額は26,768,799円（1万口当たり392.78円）であり、うち681,521円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自2019年8月7日 至2019年9月6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（1,371,689円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,535,695円）及び分配準備積立金（22,091,304円）より分配対象額は26,998,688円（1万口当たり419.93円）であり、うち642,939円（1万口当たり10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 2019年3月7日 至 2019年9月6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
	2019年9月6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

	前 期	当 期
	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在

種 類	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	11,298,887	22,326,207
合計	11,298,887	22,326,207

(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 2019年3月6日現在	当 期 2019年9月6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 2019年3月7日 至 2019年9月6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 2019年3月6日現在	当 期 2019年9月6日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9622円 (9,622円)	0.9871円 (9,871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	60,908,371	103,513,776	
	ダイワ日本国債マザーファンド	81,004,476	103,904,441	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	41,130,229	106,897,465	

	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	35,308,395	112,644,372	
	ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド	85,684,316	98,331,321	
	ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド	46,573,652	103,640,347	
親投資信託受益証券 合計			628,931,722	
合計			628,931,722	

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、「ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド」受益証券、「ダイワ日本ハーモニースtock・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」受益証券及び「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券であります。

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

### 「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

### 貸借対照表

	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	107,723,165	62,801,047
コール・ローン	69,971,476	45,873,278
国債証券	26,424,138,038	24,975,552,745
特殊債券	971,327,743	968,745,918
派生商品評価勘定	19,317,814	52,245,194

未収入金		87,566,240	53,390,706
未収利息		277,548,853	204,443,063
前払費用		-	23,508,516
差入委託証拠金		129,242,983	122,513,675
流動資産合計		28,086,836,312	26,509,074,142
資産合計		28,086,836,312	26,509,074,142
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		19,893,492	35,078,121
未払解約金		49,737,171	46,590,288
その他未払費用		8	-
流動負債合計		69,630,671	81,668,409
負債合計		69,630,671	81,668,409
純資産の部			
元本等			
元本	1	16,638,487,705	15,550,514,016
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		11,378,717,936	10,876,891,717
元本等合計		28,017,205,641	26,427,405,733
純資産合計		28,017,205,641	26,427,405,733
負債純資産合計		28,086,836,312	26,509,074,142

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年3月7日 至 2019年9月6日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<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	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
1. 1 期首	2018年9月7日	2019年3月7日
期首元本額	17,783,750,156円	16,638,487,705円
期中追加設定元本額	181,057,390円	141,294,488円
期中一部解約元本額	1,326,319,841円	1,229,268,177円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）	1,635,942,640円	1,564,782,277円
富山応援ファンド（地域企業株・外債バランス／毎月分配型）	620,874,581円	567,318,586円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	913,406,198円	876,854,459円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	46,005,013円	42,446,886円

安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	179,317,444円	170,403,274円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	331,444,464円	307,322,955円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	468,774,257円	419,234,631円
京都応援バランスファンド(隔月分配型)	210,691,517円	199,535,062円
6資産バランスファンド(分配型)	1,034,861,305円	982,454,288円
6資産バランスファンド(成長型)	115,967,840円	112,420,746円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(毎月分配型)	7,097,981,158円	6,519,142,985円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	63,859,256円	60,908,371円
ダイワ外債ソブリン・ファンド(毎月分配型)	298,766,532円	249,607,479円
兵庫応援バランスファンド(毎月分配型)	1,010,256,170円	983,843,475円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	22,436,633円	22,436,633円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	242,779,211円	227,387,062円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	1,001,804,267円	931,778,487円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(1年決算型)	13,932,756円	13,836,484円
四国アライアンス 地域創生ファンド(年1回決算型)	902,141,871円	902,572,316円
四国アライアンス 地域創生ファンド(年2回決算型)	427,244,592円	396,227,560円
計	16,638,487,705円	15,550,514,016円
2. 期末日における受益権の総数	16,638,487,705口	15,550,514,016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 2019年3月7日 至 2019年9月6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	2019年9月6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	2019年3月6日現在	2019年9月6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	810,707,704	1,220,242,833
特殊債券	37,672,806	20,520,503
合計	848,380,510	1,240,763,336

（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（2018年10月11日から2019年3月6日まで、及び2019年4月11日から2019年9月6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	2019年3月6日 現在				2019年9月6日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	2,716,646,992	-	2,700,504,388	16,142,604	2,415,747,806	-	2,450,825,927	35,078,121
アメリカ・ドル	55,860,500	-	55,860,000	500	53,193,000	-	53,520,000	327,000
カナダ・ドル	2,225,775,992	-	2,209,116,388	16,659,604	2,015,418,253	-	2,042,462,365	27,044,112
スウェーデン ・クローナ	-	-	-	-	347,136,553	-	354,843,562	7,707,009
ユーロ	435,010,500	-	435,528,000	517,500	-	-	-	-
買 建	2,660,786,492	-	2,644,068,210	16,718,282	2,362,554,806	-	2,414,800,000	52,245,194
オーストラリ ア・ドル	2,225,775,992	-	2,206,400,000	19,375,992	2,015,418,253	-	2,061,372,000	45,953,747
スウェーデン ・クローナ	435,010,500	-	437,668,210	2,657,710	-	-	-	-

ノルウェー・ クローネ	-	-	-	-	347,136,553	-	353,428,000	6,291,447
合計	5,377,433,484	-	5,344,572,598	575,678	4,778,302,612	-	4,865,625,927	17,167,073

## (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)

	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
1口当たり純資産額	1.6839円	1.6995円
(1万口当たり純資産額)	(16,839円)	(16,995円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	アメリカ・ドル 8,000,000.000	アメリカ・ドル 8,354,960.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	15,000,000.000	15,112,500.000	

	2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	13,100,000.000	14,327,077.000	
	1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	15,000,000.000	14,931,900.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20240229	8,000,000.000	8,320,000.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 61,046,437.000 (6,536,242,009)	
イギリス・ポンド	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	4,500,000.000	4,832,055.000	
	1.625% United Kingdom Gilt 20281022	3,200,000.000	3,512,384.000	
	5% United Kingdom Gilt 20250307	9,300,000.000	11,617,653.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	1,731,000.000	
	4% United Kingdom Gilt 20220307	1,500,000.000	1,634,205.000	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 23,327,297.000 (3,077,570,293)	
オーストラリア・ドル	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20200415	7,000,000.000	7,151,970.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	5,700,000.000	7,311,903.000	
	3.25% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20290421	2,900,000.000	3,506,129.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	19,000,000.000	27,209,330.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 45,179,332.000 (3,294,025,096)	
カナダ・ドル	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,500,000.000	2,145,015.000	

	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	11,500,000.000	12,121,230.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	13,500,000.000	13,711,275.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 27,977,520.000 (2,263,940,918)	
スウェーデン・ クローナ	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	29,700,000.000	スウェーデン・クローナ 32,368,545.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 32,368,545.000 (357,672,422)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,500,000.000	デンマーク・クローネ 11,046,860.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	34,000,000.000	39,546,760.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 50,593,620.000 (800,897,005)	
ノルウェー・ク ローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	15,000,000.000	ノルウェー・クローネ 15,669,600.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	4,000,000.000	4,129,040.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	20,000,000.000	21,662,600.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 41,461,240.000 (492,144,919)	
ポーランド・ズ ロチ	2.75% Poland Government Bond 20291025	20,000,000.000	ポーランド・ズロチ 21,404,000.000	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	43,000,000.000	46,773,680.000	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ	

				68,177,680.000 (1,855,114,673)
	ユーロ		ユーロ	ユーロ
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,500,000.000	2,555,700.000
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	5,200,000.000	8,777,808.000
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,500,000.000	2,688,360.000
		1% IRISH TREASURY 20260515	6,600,000.000	7,178,622.000
		1.1% IRISH TREASURY 20290515	3,600,000.000	3,987,504.000
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	15,000,000.000	17,030,700.000
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	10,000,000.000	11,126,600.000
	ユーロ 小計			ユーロ 53,345,294.000 (6,297,945,410)
国債証券 合計				24,975,552,745 [24,975,552,745]
特殊債券	カナダ・ドル		カナダ・ドル	カナダ・ドル
		2.55% CANADA HOUSING TRUST 20250315	4,500,000.000	4,719,510.000
		2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	7,000,000.000	7,252,140.000
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 11,971,650.000 (968,745,918)
特殊債券 合計				968,745,918 [968,745,918]
合計				25,944,298,663 [25,944,298,663]

- (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 5銘柄	100%	25.0%
イギリス・ポンド	国債証券 5銘柄	100%	11.9%

オーストラリア・ドル	国債証券	4銘柄	100%	12.7%
カナダ・ドル	国債証券	3銘柄	100%	12.5%
	特殊債券	2銘柄		
スウェーデン・クローナ	国債証券	1銘柄	100%	1.4%
デンマーク・クローネ	国債証券	2銘柄	100%	3.1%
ノルウェー・クローネ	国債証券	3銘柄	100%	1.9%
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	7銘柄	100%	24.3%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

### 「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

	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	250,349,891	592,416,633
国債証券	232,494,633,400	219,192,377,580
未収入金	936,320,000	-
未収利息	1,435,132,519	1,363,529,564
前払費用	89,300,514	78,107,927
流動資産合計	235,205,736,324	221,226,431,704
資産合計	235,205,736,324	221,226,431,704
負債の部		
流動負債		
未払解約金	349,106,740	86,345,073
その他未払費用	421	-
流動負債合計	349,107,161	86,345,073
負債合計	349,107,161	86,345,073
純資産の部		
元本等		

元本	1	186,064,878,810	172,402,060,399
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金( )		48,791,750,353	48,738,026,232
元本等合計		234,856,629,163	221,140,086,631
純資産合計		234,856,629,163	221,140,086,631
負債純資産合計		235,205,736,324	221,226,431,704

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年3月7日 至 2019年9月6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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
1. 1 期首	2018年9月7日	2019年3月7日
期首元本額	212,095,705,833円	186,064,878,810円
期中追加設定元本額	463,462,287円	2,017,496,218円
期中一部解約元本額	26,494,289,310円	15,680,314,629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)	4,091,058円	4,089,006円
安定重視ポートフォリオ(奇 数月分配型)	238,960,660円	227,955,626円

6 資産バランスファンド（分配型）	274,643,674円	258,150,195円
6 資産バランスファンド（成長型）	153,489,306円	148,801,883円
ダイワ日本国債ファンド（毎月分配型）	175,154,990,965円	160,690,067,248円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	84,136,626円	81,004,476円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	45,281,449円	43,716,136円
ダイワ日本国債ファンド（年1回決算型）	9,915,079,587円	10,746,459,154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）	194,205,485円	201,816,675円
計	186,064,878,810円	172,402,060,399円
2. 期末日における受益権の総数	186,064,878,810口	172,402,060,399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 2019年3月7日 至 2019年9月6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	2019年9月6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	2019年3月6日現在	2019年9月6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	2,276,994,120	985,392,820
合計	2,276,994,120	985,392,820

(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(2018年3月13日から2019年3月6日まで、及び2019年3月12日から2019年9月6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

2019年3月6日現在	2019年9月6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)

	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
1口当たり純資産額	1.2622円	1.2827円
(1万口当たり純資産額)	(12,622円)	(12,827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	11,250,000,000	14,711,962,500	
	4 30年国債	10,900,000,000	14,711,185,000	
	6 30年国債	11,250,000,000	14,777,550,000	
	7 30年国債	100,000,000	131,108,000	
	12 30年国債	11,400,000,000	14,894,556,000	
	43 20年国債	13,572,000,000	13,584,214,800	
	44 20年国債	900,000,000	913,077,000	
	48 20年国債	14,101,000,000	14,605,392,770	
	54 20年国債	13,687,000,000	14,474,002,500	
	58 20年国債	12,525,000,000	13,373,694,000	
	59 20年国債	795,000,000	848,217,300	
	68 20年国債	2,725,000,000	3,041,754,000	
	70 20年国債	10,438,000,000	11,824,166,400	
	75 20年国債	6,374,000,000	7,249,851,340	
	80 20年国債	6,473,000,000	7,406,018,220	
	86 20年国債	6,300,000,000	7,409,997,000	
	88 20年国債	6,060,000,000	7,169,949,600	
	91 20年国債	6,100,000,000	7,257,231,000	
	95 20年国債	6,105,000,000	7,386,744,750	
	101 20年国債	5,960,000,000	7,367,990,400	
102 20年国債	5,800,000,000	7,202,034,000		
111 20年国債	11,500,000,000	14,295,305,000		
142 20年国債	11,600,000,000	14,556,376,000		
国債証券 合計			219,192,377,580	
合計			219,192,377,580	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

### 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

#### 「ダイワ外国ハーモニースtock・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

	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	3,190,212	3,753,114
コール・ローン	1,914,353	2,062,157
株式	1,459,094,305	1,400,104,494
派生商品評価勘定	170	7,780
未収入金	18,635,981	15,413,918
未収配当金	1,643,531	2,212,101
流動資産合計	1,484,478,552	1,423,553,564
資産合計	1,484,478,552	1,423,553,564
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,670
未払金	16,607,505	16,166,296
未払解約金	1,000,000	-
その他未払費用	1	-
流動負債合計	17,607,506	16,167,966
負債合計	17,607,506	16,167,966
純資産の部		
元本等		
元本	1 677,948,498	632,451,198
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	788,922,548	774,934,400
元本等合計	1,466,871,046	1,407,385,598
純資産合計	1,466,871,046	1,407,385,598
負債純資産合計	1,484,478,552	1,423,553,564

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年3月7日 至 2019年9月6日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、株式の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
1. 1 期首	2018年9月7日	2019年3月7日
期首元本額	683,129,921円	677,948,498円
期中追加設定元本額	14,091,591円	2,767,658円
期中一部解約元本額	19,273,014円	48,264,958円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
6 資産バランスファンド（分配型）	163,287,403円	150,318,853円
6 資産バランスファンド（成長型）	464,528,971円	435,558,693円
世界6 資産均等分散ファンド（毎月分配型）	50,132,124円	46,573,652円
計	677,948,498円	632,451,198円
2. 期末日における受益権の総数	677,948,498口	632,451,198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 2019年3月7日 至 2019年9月6日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

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

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	2019年9月6日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種 類	2019年3月6日現在	2019年9月6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	74,965,215	125,971,574
合計	74,965,215	125,971,574

(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(2018年9月7日から2019年3月6日まで、及び2019年3月7日から2019年9月6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	2019年3月6日 現在				2019年9月6日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	1,002,145	-	1,001,975	170	7,555,925	-	7,552,726	3,199
カナダ・ドル	-	-	-	-	4,812,219	-	4,811,029	1,190
ノルウェー・ クローネ	1,002,145	-	1,001,975	170	-	-	-	-
香港・ドル	-	-	-	-	2,743,706	-	2,741,697	2,009
買 建	-	-	-	-	7,555,925	-	7,558,836	2,911
アメリカ・ドル	-	-	-	-	4,812,219	-	4,816,800	4,581
ユーロ	-	-	-	-	2,743,706	-	2,742,036	1,670
合計	1,002,145	-	1,001,975	170	15,111,850	-	15,111,562	6,110

(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)

	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1637円 (21,637円)	2.2253円 (22,253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	
	PALO ALTO NETWORKS INC	50	212.050	10,602.500	
	SYNCHRONY FINANCIAL	100	33.280	3,328.000	
	ABBOTT LABORATORIES	1,200	85.900	103,080.000	
	VERISK ANALYTICS INC	600	163.540	98,124.000	
	AFLAC INC	100	51.130	5,113.000	
	DARDEN RESTAURANTS INC	300	124.060	37,218.000	
	ADOBE INC	525	287.750	151,068.750	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	100	224.570	22,457.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	250	170.370	42,592.500	
	DR HORTON INC	1,100	49.960	54,956.000	
	MOODY'S CORP	250	219.580	54,895.000	
	CITIGROUP INC	300	66.340	19,902.000	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	200	173.270	34,654.000	
	DANAHER CORP	550	142.950	78,622.500	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	800	94.730	75,784.000	
APPLE INC	2,400	213.280	511,872.000		
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	300	81.820	24,546.000		
BOEING CO/THE	150	360.300	54,045.000		



BECTON DICKINSON AND CO	150	258.480	38,772.000	
ANSYS INC	350	218.090	76,331.500	
JPMORGAN CHASE & CO	1,700	112.370	191,029.000	
CADENCE DESIGN SYS INC	600	70.610	42,366.000	
SERVICENOW INC	425	269.620	114,588.500	
CISCO SYSTEMS INC	1,500	48.420	72,630.000	
MORGAN STANLEY	100	42.470	4,247.000	
MSCI INC	125	235.430	29,428.750	
BROADCOM INC	125	291.020	36,377.500	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	300	119.210	35,763.000	
SPLUNK INC	50	110.680	5,534.000	
BURLINGTON STORES INC	150	204.180	30,627.000	
NASDAQ INC	100	102.020	10,202.000	
AMETEK INC	600	88.330	52,998.000	
COSTCO WHOLESALE CORP	400	296.970	118,788.000	
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	100	95.410	9,541.000	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	200	93.470	18,694.000	
ASPEN TECHNOLOGY INC	550	134.900	74,195.000	
HCA HEALTHCARE INC	100	124.250	12,425.000	
T-MOBILE US INC	500	77.830	38,915.000	
COCA-COLA CO/THE	2,550	55.120	140,556.000	
CSX CORP	100	68.060	6,806.000	
AMAZON.COM INC	200	1,840.720	368,144.000	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	400	224.980	89,992.000	
EXXON MOBIL CORP	350	70.270	24,594.500	
PROOFPOINT INC	125	127.810	15,976.250	
NEXTERA ENERGY INC	450	219.810	98,914.500	
FISERV INC	700	108.700	76,090.000	
ALPHABET INC-CL C	350	1,211.380	423,983.000	
IHS MARKIT LTD	1,200	67.170	80,604.000	
HOME DEPOT INC	575	228.150	131,186.250	
NXP SEMICONDUCTORS NV	550	106.000	58,300.000	
RINGCENTRAL INC-CLASS A	700	140.510	98,357.000	
ZOETIS INC	800	128.070	102,456.000	
ALLEGION PLC	100	98.620	9,862.000	
JOHNSON & JOHNSON	600	128.580	77,148.000	
KLA CORP	550	151.000	83,050.000	
LOCKHEED MARTIN CORP	350	385.150	134,802.500	

LOWE'S COS INC	300	114.210	34,263.000
ELI LILLY & CO	100	114.600	11,460.000
LAM RESEARCH CORP	200	226.740	45,348.000
MCDONALD'S CORP	600	219.490	131,694.000
FACEBOOK INC-CLASS A	1,175	190.900	224,307.500
S&P GLOBAL INC	250	264.830	66,207.500
ATLASSIAN CORP PLC-CLASS A	200	133.340	26,668.000
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	400	163.750	65,500.000
MERCK & CO. INC.	1,650	86.100	142,065.000
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	50	128.460	6,423.000
WORKDAY INC-CLASS A	75	175.900	13,192.500
SQUARE INC - A	100	63.020	6,302.000
TRANSUNION	1,250	84.350	105,437.500
NIKE INC -CL B	750	88.420	66,315.000
NORFOLK SOUTHERN CORP	100	176.280	17,628.000
NORTHROP GRUMMAN CORP	240	368.430	88,423.200
PAYCHEX INC	200	83.800	16,760.000
PFIZER INC	1,500	36.340	54,510.000
XCEL ENERGY INC	1,200	65.150	78,180.000
STRYKER CORP	550	220.220	121,121.000
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1,400	122.760	171,864.000
TELADOC HEALTH INC	250	61.010	15,252.500
TWILIO INC - A	200	129.730	25,946.000
MATCH GROUP INC	500	81.740	40,870.000
PEPSICO INC	750	135.980	101,985.000
AMERICAN WATER WORKS CO INC	550	126.530	69,591.500
ACCENTURE PLC-CL A	300	199.490	59,847.000
QUALCOMM INC	400	78.990	31,596.000
REPUBLIC SERVICES INC	900	88.810	79,929.000
ROSS STORES INC	700	109.360	76,552.000
CHEVRON CORP	100	117.640	11,764.000
SYNOPSYS INC	600	145.950	87,570.000
SEMPRA ENERGY	550	141.830	78,006.500
TEXAS INSTRUMENTS INC	300	126.810	38,043.000
SALESFORCE.COM INC	850	153.770	130,704.500
UNION PACIFIC CORP	300	166.130	49,839.000
UNITED TECHNOLOGIES CORP	300	133.030	39,909.000
UNITEDHEALTH GROUP INC	360	229.590	82,652.400

ANTHEM INC	100	251.220	25,122.000
WALT DISNEY CO/THE	1,350	138.840	187,434.000
WASTE MANAGEMENT INC	750	119.090	89,317.500
WALMART INC	1,150	115.440	132,756.000
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	300	139.540	41,862.000
TJX COMPANIES INC	500	55.770	27,885.000
VISA INC-CLASS A SHARES	1,425	184.730	263,240.250
PULTEGROUP INC	1,600	34.250	54,800.000
NVIDIA CORP	425	179.740	76,389.500
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	50	131.560	6,578.000
TYSON FOODS INC-CL A	500	85.260	42,630.000
NETFLIX INC	50	293.250	14,662.500
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	250	294.020	73,505.000
MASTERCARD INC - A	850	292.080	248,268.000
YUM! BRANDS INC	700	118.160	82,712.000
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	200	131.350	26,270.000
BANK OF AMERICA CORP	2,000	28.120	56,240.000
AMERICAN EXPRESS CO	1,350	120.670	162,904.500
ANALOG DEVICES INC	250	113.020	28,255.000
ADVANCED MICRO DEVICES	1,800	31.500	56,700.000
AON PLC	100	195.600	19,560.000
AMGEN INC	150	207.650	31,147.500
APPLIED MATERIALS INC	1,000	50.350	50,350.000
CME GROUP INC	400	221.180	88,472.000
SCHWAB (CHARLES) CORP	100	39.620	3,962.000
BAXTER INTERNATIONAL INC	900	87.910	79,119.000
CERNER CORP	300	67.850	20,355.000
INTEL CORP	1,500	50.100	75,150.000
ILLUMINA INC	50	271.780	13,589.000
INTUITIVE SURGICAL INC	50	508.170	25,408.500
TARGET CORP	500	108.540	54,270.000
MICROSOFT CORP	6,250	140.050	875,312.500
MEDTRONIC PLC	1,000	107.720	107,720.000
BLACKROCK INC	20	424.720	8,494.400
KANSAS CITY SOUTHERN	100	129.920	12,992.000
CHUBB LTD	200	160.630	32,126.000

	PAYPAL HOLDINGS INC	1,000	111.460	111,460.000	
	XILINX INC	100	105.300	10,530.000	
	ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	100	204.980	20,498.000	
	TRIMBLE INC	400	37.890	15,156.000	
	IDEXX LABORATORIES INC	150	289.930	43,489.500	
	STARBUCKS CORP	750	95.560	71,670.000	
	INTUIT INC	450	292.310	131,539.500	
	BOSTON SCIENTIFIC CORP	2,700	42.610	115,047.000	
	COMCAST CORP-CLASS A	1,100	46.410	51,051.000	
アメリカ・ドル 小計				アメリカ・ドル 10,696,861.250 (1,145,312,934)	
イギリス・ポンド		株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	BP PLC	5,000	5.070	25,350.000	
	UNILEVER PLC	250	51.790	12,947.500	
	DIAGEO PLC	1,600	34.890	55,824.000	
	RIO TINTO PLC	550	42.205	23,212.750	
	ASTRAZENECA PLC	450	71.910	32,359.500	
	ASHTREAD GROUP PLC	500	23.010	11,505.000	
	BHP GROUP PLC	1,900	17.506	33,261.400	
	HSBC HOLDINGS PLC	1,500	5.988	8,982.000	
	INTERMEDIATE CAPITAL GROUP	1,000	13.860	13,860.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	700	72.080	50,456.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	2,900	22.845	66,250.500	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 334,008.650 (44,065,761)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	CAE INC	1,900	33.750	64,125.000	
	SHOPIFY INC - CLASS A	200	519.510	103,902.000	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	300	124.040	37,212.000	
	OPEN TEXT CORP	300	54.940	16,482.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 221,721.000 (17,941,663)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	250	271.050	67,762.500	
	NESTLE SA-REG	1,350	111.900	151,065.000	

	NOVARTIS AG-REG	800	88.180	70,544.000	
	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	800	40.790	32,632.000	
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 322,003.500 (34,930,940)	
デンマーク・ク ローネ		株	デンマーク・クローネ	デンマーク・クローネ	
	NOVO NORDISK A/S-B	1,200	355.050	426,060.000	
	DSV A/S	750	693.200	519,900.000	
デンマーク・クローネ	小計			デンマーク・クローネ 945,960.000 (14,974,546)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	ALLIANZ SE-REG	100	203.050	20,305.000	
	SAP SE	350	111.480	39,018.000	
	WIRECARD AG	250	157.500	39,375.000	
	ADIDAS AG	175	274.800	48,090.000	
	PUMA SE	250	68.700	17,175.000	
	DEUTSCHE BOERSE AG	100	136.250	13,625.000	
	VONOVIA SE	500	43.310	21,655.000	
	WOLTERS KLUWER	1,000	66.060	66,060.000	
	ASML HOLDING NV	500	215.100	107,550.000	
	GALAPAGOS NV	350	149.400	52,290.000	
	UNILEVER NV	700	56.890	39,823.000	
	TOTAL SA	250	46.225	11,556.250	
	KERING	25	455.400	11,385.000	
	DANONE	200	81.800	16,360.000	
	L'OREAL	100	250.700	25,070.000	
	PERNOD RICARD SA	250	174.600	43,650.000	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	100	376.400	37,640.000	
	DASSAULT SYSTEMES SA	50	128.850	6,442.500	
	VINCI SA	200	100.900	20,180.000	
	AIRBUS SE	900	127.320	114,588.000	
	SAFRAN SA	300	138.000	41,400.000	
ユーロ	小計			ユーロ 793,237.750 (93,649,649)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	2,500	247.200	618,000.000	

	TENCENT HOLDINGS LTD	2,400	341.400	819,360.000	
	AIA GROUP LTD	7,400	78.550	581,270.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	17,000	93.250	1,585,250.000	
香港・ドル	小計			香港・ドル 3,603,880.000 (49,229,001)	
合計				1,400,104,494 [1,400,104,494]	

## (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 139銘柄	100%	81.8%
イギリス・ポンド	株式 11銘柄	100%	3.1%
カナダ・ドル	株式 4銘柄	100%	1.3%
スイス・フラン	株式 4銘柄	100%	2.5%
デンマーク・クローネ	株式 2銘柄	100%	1.1%
ユーロ	株式 21銘柄	100%	6.7%
香港・ドル	株式 4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

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ日本ハーモニースtock・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

	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
	金額(円)	金額(円)

資産の部		
流動資産		
コール・ローン	55,099,201	90,979,194
株式	1,345,667,160	1,303,217,600
未収入金	31,304,129	14,527,616
未収配当金	2,205,000	1,298,500
流動資産合計	1,434,275,490	1,410,022,910
資産合計	1,434,275,490	1,410,022,910
負債の部		
流動負債		
未払金	28,746,680	22,337,913
その他未払費用	35	-
流動負債合計	28,746,715	22,337,913
負債合計	28,746,715	22,337,913
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,171,985,243
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	233,543,532	178,505,630
元本等合計	1,405,528,775	1,387,684,997
純資産合計	1,405,528,775	1,387,684,997
負債純資産合計	1,434,275,490	1,410,022,910

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年3月7日 至 2019年9月6日
1. 有価証券の評価基準及び評価 方法	株式

2. 収益及び費用の計上基準	<p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p> <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、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	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
1. 1 期首	2018年9月7日	2019年3月7日
期首元本額	1,156,161,088円	1,171,985,243円
期中追加設定元本額	35,781,189円	48,098,826円
期中一部解約元本額	19,957,034円	10,904,702円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
6 資産バランスファンド(分	283,226,499円	287,802,682円
配型)		
6 資産バランスファンド(成	803,074,428円	835,692,369円
長型)		
世界 6 資産均等分散ファンド	85,684,316円	85,684,316円
(毎月分配型)		
計	1,171,985,243円	1,209,179,367円
2. 期末日における受益権の総数	1,171,985,243口	1,209,179,367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 2019年3月7日 至 2019年9月6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、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	2019年9月6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	2019年3月6日現在	2019年9月6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	35,154,689	36,899,318
合計	35,154,689	36,899,318

（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（2018年9月7日から2019年3月6日まで、及び2019年3月7日から2019年9月6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

2019年3月6日現在	2019年9月6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)

	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1993円 (11,993円)	1.1476円 (11,476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	
五洋建設	40,000	557.00	22,280,000	
森永乳業	5,100	4,380.00	22,338,000	
ディー・エヌ・エー	7,000	2,059.00	14,413,000	
ハウス食品G本社	4,700	3,985.00	18,729,500	
カゴメ	15,000	2,715.00	40,725,000	
東急不動産HD	33,600	661.00	22,209,600	
ワコールホールディングス	17,000	2,529.00	42,993,000	
信越化学	3,400	11,170.00	37,978,000	
三井化学	8,000	2,301.00	18,408,000	
野村総合研究所	22,000	2,180.00	47,960,000	
電通	5,400	3,650.00	19,710,000	
参天製薬	16,800	1,793.00	30,122,400	
第一三共	7,000	7,048.00	49,336,000	
オリエンタルランド	2,300	15,970.00	36,731,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	6,000	3,015.00	18,090,000	
A G C	14,000	3,185.00	44,590,000	
日本特殊陶業	20,000	1,877.00	37,540,000	
住友鉱山	5,300	3,220.00	17,066,000	
リクルートホールディングス	11,100	3,255.00	36,130,500	
ディスコ	1,900	20,840.00	39,596,000	
サト-ホールディングス	6,300	2,671.00	16,827,300	
ダイキン工業	2,800	14,075.00	39,410,000	
明電舎	27,000	1,755.00	47,385,000	
日本電産	2,700	13,975.00	37,732,500	
ソニー	12,000	6,360.00	76,320,000	
デンソー	6,200	4,596.00	28,495,200	

ヤマハ	5,000	4,615.00	23,075,000	
ピジヨン	12,200	4,200.00	51,240,000	
任 天 堂	400	41,450.00	16,580,000	
コ ク ヨ	17,500	1,396.00	24,430,000	
東京エレクトロン	2,200	20,005.00	44,011,000	
キヤノンマーケティングJPN	19,000	2,140.00	40,660,000	
パ ル コ	15,000	1,258.00	18,870,000	
ヤオコー	6,000	4,675.00	28,050,000	
三菱UFJフィナンシャルG	97,000	519.80	50,420,600	
東京海上HD	11,000	5,567.00	61,237,000	
N T Tデータ	25,000	1,374.00	34,350,000	
ダイセキ	18,000	2,621.00	47,178,000	
合計			1,303,217,600	

## (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

該当事項はありません。

## 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,543,868,115	3,602,660,208
コール・ローン	653,021,740	495,640,242
投資証券	92,520,739,308	87,300,917,568
派生商品評価勘定	681,114	63,312
未収入金	793,536,581	763,502,565
未収配当金	159,779,447	126,757,171
流動資産合計	96,671,626,305	92,289,541,066

資産合計		96,671,626,305	92,289,541,066
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		-	147,353
未払金		-	820,142,801
未払解約金		411,086,000	151,624,000
その他未払費用		234	-
流動負債合計		411,086,234	971,914,154
負債合計		411,086,234	971,914,154
純資産の部			
元本等			
元本	1	38,940,249,296	35,135,908,736
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		57,320,290,775	56,181,718,176
元本等合計		96,260,540,071	91,317,626,912
純資産合計		96,260,540,071	91,317,626,912
負債純資産合計		96,671,626,305	92,289,541,066

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年3月7日 至 2019年9月6日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

	<p>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、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	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
1. 1 期首	2018年9月7日	2019年3月7日
期首元本額	43,223,443,814円	38,940,249,296円
期中追加設定元本額	111,253,368円	100,166,544円
期中一部解約元本額	4,394,447,886円	3,904,507,104円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルREI	34,994,666,986円	31,390,488,356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）	31,863,069円	28,704,641円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	17,527,925円	15,947,599円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	16,061,728円	14,081,889円

成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	80,980,014円	68,694,865円
6資産バランスファンド(分配型)	142,478,197円	130,605,143円
6資産バランスファンド(成長型)	329,846,667円	299,421,790円
りそな ワールド・リート・ファンド	1,562,465,601円	1,443,067,412円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	45,094,331円	41,130,229円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	4,310,926円	3,832,381円
常陽3分法ファンド	210,799,873円	187,564,119円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	48,832,750円	43,335,137円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	235,712,217円	255,360,474円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	312,024,821円	329,124,764円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	397,104,938円	427,999,733円
ダイワ・グローバルREITファンド(ダイワSMA専用)	31,976,417円	30,116,510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)	421,940,309円	371,860,729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)	24,671,438円	24,012,316円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド(為替ヘッジなし)	31,891,089円	30,560,649円
計	38,940,249,296円	35,135,908,736円
2. 期末日における受益権の総数	38,940,249,296口	35,135,908,736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 2019年3月7日 至 2019年9月6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	2019年9月6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	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	4,375,061,435	6,796,303,775
合計	4,375,061,435	6,796,303,775

（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（2018年9月19日から2019年3月6日まで、及び2019年3月16日から2019年9月6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	2019年3月6日 現在				2019年9月6日 現在			
	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益	契約額等	うち 1年超	時価	評価損益
	(円)		(円)	(円)	(円)		(円)	(円)
市場取引以外の 取引								
為替予約取引								
売 建	833,182,382	-	833,155,385	26,997	181,599,704	-	181,536,392	63,312
アメリカ・ドル	502,744,500	-	502,740,000	4,500	152,272,537	-	152,229,871	42,666
イギリス・ ポンド	330,437,882	-	330,415,385	22,497	1,416,686	-	1,416,472	214
香港・ドル	-	-	-	-	27,910,481	-	27,890,049	20,432
買 建	330,437,882	-	331,091,999	654,117	181,599,704	-	181,452,351	147,353
アメリカ・ドル	330,437,882	-	331,091,999	654,117	29,327,167	-	29,314,975	12,192
ニュージ- ランド・ドル	-	-	-	-	25,746,903	-	25,732,899	14,004
ユーロ	-	-	-	-	126,525,634	-	126,404,477	121,157
合計	1,163,620,264	-	1,164,247,384	681,114	363,199,408	-	362,988,743	84,041

（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)

	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4720円 (24,720円)	2.5990円 (25,990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	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	300,462	8,307,774.300	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	99,375	14,912,212.500	
		BOSTON PROPERTIES INC	61,542	7,977,074.040	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	224,920	11,486,664.400	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	24,169	6,361,280.800	
		EQUINIX INC	22,225	12,245,975.000	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	312,114	8,985,762.060	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	127,869	2,137,969.680	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	291,589	9,960,680.240	
		CYRUSONE INC	188,705	13,905,671.450	

	PARK HOTELS & RESORTS INC	356,213	8,655,975.900	
	INVITATION HOMES INC	710,649	20,331,667.890	
	VICI PROPERTIES INC	673,625	14,947,738.750	
	VEREIT INC	1,428,138	13,795,813.080	
	SUN COMMUNITIES INC	138,273	20,504,503.170	
	PROLOGIS INC	325,005	27,492,172.950	
	SITE CENTERS CORP	442,920	6,307,180.800	
	DUKE REALTY CORP	308,952	10,318,996.800	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	94,697	30,750,009.840	
	WELLTOWER INC	394,643	35,948,030.870	
	KILROY REALTY CORP	187,141	14,529,627.240	
	MACERICH CO/THE	247,713	7,381,847.400	
	REALTY INCOME CORP	192,323	14,424,225.000	
	PUBLIC STORAGE	83,677	21,610,422.020	
	REGENCY CENTERS CORP	161,293	10,738,887.940	
	UDR INC	686,757	33,204,700.950	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	151,846	6,284,905.940	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	168,954	20,477,224.800	
	DOUGLAS EMMETT INC	101,507	4,259,233.720	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 418,244,229.530 (44,781,409,655)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	7,261,555	5,133,919.380	
	SEGRO PLC	1,657,433	13,034,053.110	
	UNITE GROUP PLC	719,439	7,482,165.600	
	BRITISH LAND CO PLC	2,232	11,646.570	
	DERWENT LONDON PLC	137,415	4,301,089.500	
	WORKSPACE GROUP PLC	124,172	1,082,158.980	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	698,200	4,653,503.000	
	BIG YELLOW GROUP PLC	407,429	4,335,044.560	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	3,921,785	8,165,156.370	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	808,022	1,144,967.170	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 49,343,704.240 (6,509,914,901)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	NATIONAL STORAGE REIT	12,282,483	22,292,706.640	

	GPT GROUP	1,846,877	11,653,793.870	
	MIRVAC GROUP	10,715,083	33,645,360.620	
	GOODMAN GROUP	1,845,608	25,838,512.000	
	CHARTER HALL GROUP	2,082,569	26,677,708.890	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	6,011,756	24,227,376.680	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 144,335,458.700 (10,523,498,294)	
カナダ・ドル	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	397,407	カナダ・ドル 17,509,752.420	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	403,368	21,261,527.280	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 38,771,279.700 (3,137,371,953)	
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	11,934,213	シンガポール・ドル 21,720,267.660	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	4,624,000	14,843,040.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	6,252,477	19,382,678.700	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	5,995,235	14,268,659.300	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 70,214,645.660 (5,429,698,549)	
ニュージーランド・ドル	GOODMAN PROPERTY TRUST	3,593,087	ニュージーランド・ドル 7,958,687.700	
	ニュージーランド・ドル 小計			ニュージーランド・ドル 7,958,687.700 (543,021,262)
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	643,858	ユーロ 9,780,203.020	
	NSI NV	78,299	3,092,810.500	
	ARGAN	13,812	875,680.800	
	GECINA SA	77,999	11,005,658.900	
	KLEPIERRE	927,482	25,858,198.160	
	COVIVIO	195,484	18,786,012.400	
	AEDIFICA	60,548	6,478,636.000	
	BEFIMMO	69,937	3,776,598.000	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	26,275	4,482,515.000	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	649,312	6,889,200.320	

	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	472,059	5,707,193.310	
ユーロ	小計		ユーロ 96,732,706.410 (11,420,263,318)	
香港・ドル	LINK REIT	3,526,305	香港・ドル 315,251,667.000	
	CHAMPION REIT	9,160,000	47,540,400.000	
香港・ドル	小計		香港・ドル 362,792,067.000 (4,955,739,636)	
投資証券	合計		87,300,917,568 [87,300,917,568]	
合計			87,300,917,568 [87,300,917,568]	

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 29銘柄	100%	51.2%
イギリス・ポンド	投資証券 10銘柄	100%	7.5%
オーストラリア・ドル	投資証券 6銘柄	100%	12.1%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	100%	3.6%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	6.2%
ニュージーランド・ドル	投資証券 1銘柄	100%	0.6%
ユーロ	投資証券 11銘柄	100%	13.1%
香港・ドル	投資証券 2銘柄	100%	5.7%

## 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。

「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

	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	151,162,537	222,035,706
投資証券	105,412,829,560	124,187,016,840
未収入金	632,341,379	787,470,630
未収配当金	1,349,841,428	1,246,677,869
流動資産合計	107,546,174,904	126,443,201,045
資産合計	107,546,174,904	126,443,201,045
負債の部		
流動負債		
未払金	512,813,961	252,311,759
未払解約金	30,910,000	30,344,000
その他未払費用	401	-
流動負債合計	543,724,362	282,655,759
負債合計	543,724,362	282,655,759
純資産の部		
元本等		
元本	1 39,454,942,620	39,544,852,747
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	67,547,507,922	86,615,692,539
元本等合計	107,002,450,542	126,160,545,286
純資産合計	107,002,450,542	126,160,545,286
負債純資産合計	107,546,174,904	126,443,201,045

## 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区分	自 2019年3月7日 至 2019年9月6日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券

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

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
1. 1 期首	2018年9月7日	2019年3月7日
期首元本額	40,889,807,890円	39,454,942,620円
期中追加設定元本額	1,141,147,396円	3,663,255,194円
期中一部解約元本額	2,576,012,666円	3,573,345,067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）	15,946,966円	13,218,788円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	14,549,584円	12,122,788円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	72,126,808円	56,862,845円
6資産バランスファンド（分配型）	128,140,013円	111,232,144円
6資産バランスファンド（成長型）	295,495,330円	248,532,473円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	41,488,379円	35,308,395円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	1,772,953円	1,632,508円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	43,858,213円	36,360,922円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽ノ安定コース）	212,408,997円	211,815,005円

DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	280,039,389円	277,049,592円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	355,113,649円	363,548,026円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	348,323,869円	365,940,669円
ダイワファンドラップJ-REITセレクト	36,693,274,998円	37,012,231,005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）	97,487,586円	77,223,232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）	32,934,079円	27,149,917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）	158,303,279円	126,159,448円
ダイワ・アクティブリリート・ファンド（年4回決算型）	663,678,528円	568,464,990円
計	39,454,942,620円	39,544,852,747円
2. 期末日における受益権の総数	39,454,942,620口	39,544,852,747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 2019年3月7日 至 2019年9月6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	2019年9月6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	2019年3月6日現在	2019年9月6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	3,412,764,622	13,566,365,001
合計	3,412,764,622	13,566,365,001

(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（2018年11月13日から2019年3月6日まで、及び2019年5月11日から2019年9月6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

2019年3月6日現在	2019年9月6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)

	2019年3月6日現在	2019年9月6日現在
1口当たり純資産額	2.7120円	3.1903円
(1万口当たり純資産額)	(27,120円)	(31,903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	サンケイリアルエステート	2,274	274,699,200	
	日本アコモデーションファンド投資法人	1,136	772,480,000	
	MCUBS MidCity投資法人	11,886	1,335,986,400	
	森ヒルズリート	30,348	5,086,324,800	
	産業ファンド	11,933	1,801,883,000	
	アドバンス・レジデンス	8,695	3,051,945,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	13,322	2,731,010,000	
	API投資法人	7,240	3,808,240,000	
	GLP投資法人	15,665	2,121,041,000	
	コンフォリア・レジデンシャル	5,840	2,038,160,000	
	日本プロロジスリート	23,082	6,686,855,400	
	星野リゾート・リート	4,316	2,412,644,000	
	ヒューリックリート投資法	5,966	1,138,909,400	
	日本リート投資法人	452	199,332,000	
	インベスコ・オフィス・Jリート	169,276	3,417,682,440	
	日本ヘルスケア投資法	416	76,544,000	
	積水ハウス・リート投資	42,818	3,943,537,800	
	ケネディクス商業リート	4,959	1,424,720,700	
	ヘルスケア&メディカル投資	3,367	459,258,800	
	野村不動産マスターF	37,828	7,138,143,600	
	ラサールロジポート投資	13,771	2,072,535,500	
	三井不ロジパーク	4,998	2,156,637,000	
	大江戸温泉リート	8,484	745,743,600	
	森トラスト・ホテルリート投	6,304	875,625,600	
	三菱地所物流REIT	2,240	710,080,000	
	CREロジスティクスファンド	6,548	836,179,600	
	ザイマックス・リート	7,478	991,582,800	
伊藤忠アドバンスロジ	1,636	178,814,800		
日本ビルファンド	7,866	6,174,810,000		
ジャパンリアルエステイト	15,946	11,433,282,000		
日本リテールファンド	20,530	4,405,738,000		

オリックス不動産投資	18,844	4,400,074,000	
日本プライムリアルティ	5,801	2,871,495,000	
プレミア投資法人	7,933	1,221,682,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,740	265,872,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	11,517	2,337,951,000	
森トラスト総合リート	14,144	2,835,872,000	
インヴィンシブル投資法人	51,615	3,427,236,000	
フロンティア不動産投資	2,989	1,362,984,000	
福岡リート投資法人	11,510	2,060,290,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	6,178	5,084,494,000	
いちごオフィスリート投資法人	12,853	1,363,703,300	
大和証券オフィス投資法人	2,580	2,154,300,000	
阪急阪神リート投資法人	7,281	1,147,485,600	
スターツプロシード投資法人	4,105	809,095,500	
大和ハウスリート投資法人	25,236	7,381,530,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	26,396	2,164,472,000	
日本賃貸住宅投資法人	25,750	2,590,450,000	
ジャパンエクセレント投資法人	1,207	207,604,000	
投資証券 合計		124,187,016,840	
合計		124,187,016,840	

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。

## 2 【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

2019年9月30日

資産総額	638,570,360円
負債総額	1,052,206円
純資産総額（ - ）	637,518,154円
発行済数量	639,757,448口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.9965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

2019年9月30日

資産総額	26,410,609,089円
負債総額	45,096,841円
純資産総額（ - ）	26,365,512,248円
発行済数量	15,470,141,118口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.7043円

## (参考) ダイワ日本国債マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年9月30日

資産総額	219,613,062,180円
負債総額	51,917,546円
純資産総額（ - ）	219,561,144,634円
発行済数量	171,487,474,397口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.2803円

## (参考) ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年9月30日

資産総額	1,400,100,850円
負債総額	9,764,379円
純資産総額( - )	1,390,336,471円
発行済数量	636,972,220口
1単位当たり純資産額( / )	2.1827円

## (参考) ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年9月30日

資産総額	1,435,724,759円
負債総額	12円
純資産総額( - )	1,435,724,747円
発行済数量	1,208,418,318口
1単位当たり純資産額( / )	1.1881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

2019年9月30日

資産総額	94,511,247,588円
負債総額	2,435,270,431円
純資産総額( - )	92,075,977,157円
発行済数量	34,895,722,325口
1単位当たり純資産額( / )	2.6386円

## (参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

## 純資産額計算書

2019年9月30日

資産総額	127,790,449,266円
負債総額	918,411,078円
純資産総額( - )	126,872,038,188円

発行済数量	38,570,349,475口
1 単位当たり純資産額（ / ）	3.2894円

## 第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等  
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典  
ありません。

(3) 譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。

(4) 受益証券の再発行  
受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(5) 受益権の譲渡  
受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(6) 受益権の譲渡の対抗要件  
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

(7) 受益権の再分割  
委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(8) 償還金  
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。

## 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】

##### a. 資本金の額

2019年9月末日現在

資本金の額 151億7,427万2,500円

発行可能株式総数 799万9,980株

発行済株式総数 260万8,525株

過去5年間ににおける資本金の額の増減：該当事項はありません。

##### b. 委託会社の機構

###### 会社の意思決定機構

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

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

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

###### 投資運用の意思決定機構

投資運用の意思決定機構の概要は、以下のとおりとなっています。

##### イ. ファンド個別会議

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

##### ロ. 投資環境検討会

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

##### ハ. 運用会議

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

##### ニ. 運用部長・ファンドマネージャー

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

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

・ファンド評価会議



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

・運用審査会議

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

・リスクマネジメント会議

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

・執行役員会議

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

## 2 【事業の内容及び営業の概況】

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

2019年9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	63	119,570
追加型株式投資信託	712	15,788,257
株式投資信託 合計	775	15,907,827
単位型公社債投資信託	28	94,090
追加型公社債投資信託	14	1,400,808
公社債投資信託 合計	42	1,494,898
総合計	817	17,402,725

## 3 【委託会社等の経理状況】

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(2018年4月1日から2019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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	28,709	28,489
有価証券	0	554
前払費用	201	214
未収委託者報酬	12,368	11,468
未収収益	82	98
その他	47	56
流動資産計	41,410	40,882
固定資産		
有形固定資産	1	206
建物	12	10
器具備品	200	195
無形固定資産	2,614	2,821
ソフトウェア	2,456	2,804
ソフトウェア仮勘定	158	17
投資その他の資産	15,066	12,799
投資有価証券	8,600	8,493
関係会社株式	5,129	1,836
出資金	183	183
長期差入保証金	1,072	1,070
繰延税金資産	1,078	1,183
その他	34	31
固定資産計	18,927	15,827
資産合計	60,337	56,709

(単位:百万円)

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	65	75
未払金	9,747	8,548
未払収益分配金	8	15
未払償還金	59	40
未払手数料	5,202	4,610
その他未払金	2 4,476	2 3,882
未払費用	4,148	3,735
未払法人税等	850	726
未払消費税等	583	255
賞与引当金	1,012	725
その他	335	2
流動負債計	16,744	14,070
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,350	2,389
役員退職慰労引当金	125	103
その他	5	2
固定負債計	2,481	2,496
負債合計	19,225	16,567
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,850	13,052
利益剰余金合計	14,225	13,426
株主資本合計	40,895	40,096
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	216	46
評価・換算差額等合計	216	46
純資産合計	41,112	40,142
負債・純資産合計	60,337	56,709

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	82,510	76,052
その他営業収益	733	673
営業収益計	83,244	76,725
営業費用		
支払手数料	40,392	35,789
広告宣伝費	673	694
調査費	9,816	9,066
調査費	955	1,057
委託調査費	8,860	8,009
委託計算費	839	1,351
営業雑経費	1,579	1,557
通信費	249	228
印刷費	500	513
協会費	53	55
諸会費	13	13
その他営業雑経費	762	746
営業費用計	53,300	48,459
一般管理費		
給料	5,840	5,755
役員報酬	377	373
給料・手当	3,973	4,145
賞与	477	510
賞与引当金繰入額	1,012	725
福利厚生費	788	796
交際費	55	64
旅費交通費	195	178
租税公課	501	472
不動産賃借料	1,281	1,291
退職給付費用	316	374

役員退職慰労引当金繰入額	46	34
固定資産減価償却費	977	907
諸経費	1,528	1,819
一般管理費計	11,531	11,693
営業利益	18,411	16,572

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31 日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
投資有価証券売却益	210	215
有価証券償還益	17	133
その他	130	172
営業外収益計	359	521
営業外費用		
投資有価証券売却損	0	40
有価証券償還損	3	32
その他	25	60
営業外費用計	29	132
経常利益	18,741	16,961
特別損失		
関係会社整理損失	333	29
特別損失計	333	29
税引前当期純利益	18,407	16,931
法人税、住民税及び事業税	5,843	5,076
法人税等調整額	106	15
法人税等合計	5,737	5,060
当期純利益	12,670	11,870

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

(単位:百万円)

	株主資本					株主資本合計
	資本金	資本剰余金	利益剰余金			
		資本準備金	利益準備金	その他利益	利益剰余金	
				剰余金		
			繰越利益			
			剰余金			

当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	12,712	13,086	39,756
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	13,850	14,225	40,895

	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
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	264	264	40,021
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	41,112

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					株主資本合計	
	資本金	資本剰余金	利益剰余金		利益剰余金合計		
		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	13,850	14,225	40,895
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
当期純利益	-	-	-	11,870	11,870	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	798	798	798
当期末残高	15,174	11,495	374	13,052	13,426	40,096

	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	216	216	41,112
会計方針の変更による累積的影響額	-	-	-
会計方針の変更を反映した当期首残高	216	216	41,112
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
当期純利益	-	-	11,870
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	170	170	170
当期変動額合計	170	170	969
当期末残高	46	46	40,142

## 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。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

「税効果会計に係る会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日)を当事業年度の期首から適用しており、子会社株式等に対する投資に係る将来加算一時差異に基づく繰延税金負債を過年度に遡及して取り崩した結果、貸借対照表の繰延税金負債が480百万円減少し、株主資本等変動計算書の繰越利益剰余金の遡及適用後の前事業年度期首残高が480百万円増加しております。



（未適用の会計基準等）

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

## （1）概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

## （2）適用予定日

当財務諸表の作成時において検討中であります。

## （3）当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

## （表示方法の変更）

（『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）等を当事業年度の期首から適用しており、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示しております。

## （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「受取配当金」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「受取配当金」75百万円、「その他」55百万円は、「その他」130百万円として組替えております。

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外費用」の「その他」に表示していた29百万円は、「有価証券償還損」3百万円、「その他」25百万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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	29百万円	31百万円

器具備品

235百万円

264百万円

## 2 関係会社項目

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

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
未払金	4,406百万円	3,788百万円

## 3 保証債務

前事業年度(2018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。

当事業年度(2019年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,719百万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2017年4月1日至2018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
2017年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	2017年 3月31日	2017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

2018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	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月26日

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年 3月31日	2018年 6月26日

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

2019年6月21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	11,868百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,550円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月24日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は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。

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(2018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。

当事業年度(2019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		28,489	28,489	-

(2) 未収委託者報酬	11,468	11,468	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	8,380	8,380	-
資産計	48,338	48,338	-
(1) 未払手数料	(4,610)	(4,610)	-
(2) その他未払金	(3,882)	(3,882)	-
(3) 未払費用(*2)	(2,805)	(2,805)	-
負債計	(11,298)	(11,298)	-

(\*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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	666
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	1,836
(3) 長期差入保証金	1,072	1,070

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(2018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

当事業年度(2019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	28,489	-	-	-
未収委託者報酬	11,468	-	-	-
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	554	4,284	2,227	1,227
合計	40,512	4,284	2,227	1,227

(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(2018年3月31日)

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

当事業年度(2019年3月31日)

子会社株式(貸借対照表計上額 1,836百万円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 2. その他有価証券

前事業年度(2018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。

当事業年度(2019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	87	55	32
(2)その他 証券投資信託	4,991	4,712	278
小計	5,079	4,767	311
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	3,301	3,560	258
小計	3,301	3,560	258
合計	8,380	8,328	52

(注)非上場株式(貸借対照表計上額 666百万円)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 2017年4月1日 至 2018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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	389	86	-
(2)その他 証券投資信託	3,517	128	40
合計	3,907	215	40

### 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おります。

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	前事業年度	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
退職給付債務の期首残高	2,318百万円	2,350百万円
勤務費用	159	158
退職給付の支払額	166	171
その他	38	52
退職給付債務の期末残高	2,350	2,389

## (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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
非積立型制度の退職給付債務	2,350百万円	2,389百万円
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389
退職給付引当金	2,350	2,389
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,350	2,389

## (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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
勤務費用	159百万円	158百万円
その他	24	41
確定給付制度に係る退職給付費用	184	199

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度171百万円、当事業年度174百万円であります。



## （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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
<b>繰延税金資産</b>		
退職給付引当金		731
	719	
賞与引当金	244	182
システム関連費用	16	170
未払事業税	162	141
出資金評価損	94	94
投資有価証券評価損	68	32
その他	297	240
繰延税金資産小計	1,602	1,592
評価性引当額	200	164
繰延税金資産合計	1,402	1,428
<b>繰延税金負債</b>		
連結法人間取引（譲渡益）	159	159
その他有価証券評価差額金	164	85
繰延税金負債合計	323	244
繰延税金資産の純額	1,078	1,183

(注)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の繰延税金負債の連結法人間取引（譲渡益）は480百万円減少しております。

## 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（2018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（2019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 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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 2017年4月1日 至 2018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、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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)	1,719	-	-
子会社	Daiwa Portfolio Advisory (India) Private Ltd.	India	1,207	金融商品取引業	(所有)直接91.0	経営管理	有償減資(注2)	3,293	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 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、及びMASへの全て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るとおりに決定しております。

(注2) 当該子会社における株主総会決議及びインド会社法法廷の承認に基づき払戻しを受けております。

(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 2017年4月1日 至 2018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)(注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	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(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,048	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せん。

(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 2018年4月1日 至 2019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) (注1)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	19,975	未払手数料	3,400
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,052	未払費用	173
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,063	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せん。

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1株当たり純資産額	15,760.66円	1株当たり純資産額	15,389.06円
1株当たり当期純利益	4,857.40円	1株当たり当期純利益	4,550.81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おりません。

(注2)「会計方針の変更」に記載のとおり、当事業年度における会計方針の変更は遡及適用され、前事業年度については遡及適用後の財務諸表となっております。この結果、遡及適用を行う前と比べて、前事業年度の1株当たり純資産額は184円26銭増加しております。

(注3)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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(百万円)	12,670	11,870

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】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

2020年4月1日付で、定款について次の変更を行なう予定です。

- ・ 商号の変更（大和アセットマネジメント株式会社に変更）

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

## 第2 【その他の関係法人の概況】

### 1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2019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 株式会社関西みらい銀行

資本金の額 38,900百万円（2019年4月1日現在）

事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

<参考> 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」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 518千米ドル（約57百万円）（2018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】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2019年3月末日現在）

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

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

### 第3 【その他】

#### (1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第13条の規定に基づく目論見書である旨を記載することがあります。

目論見書の別称として「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を用いることがあります。

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

- ・委託会社のホームページアドレス、電話番号及び受付時間等
- ・請求目論見書の入手方法及び投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨  
使用開始日を記載することがあります。

届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。

- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日  
次の事項を記載することがあります。
- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨

- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載  
委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

次の事項を記載することがあります。

- ・大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更します。2020年4月1日以降、「大和投資信託」「大和証券投資信託委託株式会社」など当社名を表す記載につきましては、「大和アセットマネジメント株式会社」とお読み替え下さい。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。



## 独立監査人の監査報告書

2019年5月24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	小倉 加奈子	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治	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2018年4月1日から2019年3月31日までの第60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2019年3月31日現在の財政状態及び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。

## 独立監査人の監査報告書

2019年10月4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 深井 康治 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」に掲げられている世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）の2019年3月7日から2019年9月6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、世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）の2019年9月6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。