

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成30年11月29日提出
【計算期間】	第25特定期間 (自 平成30年3月7日 至 平成30年9月6日)
【ファンド名】	世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)
【発行者名】	大和証券投資信託委託株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 岩本 信之
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	高橋 慎
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部 【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	年1回	グローバル (含む日本)		
大型株				
中小型株	年2回	日本		
債券				
一般	年4回	北米	ファミリー ファンド	あり ( )
公債		欧州		
社債	年6回 (隔月)	アジア		
その他債券		オセアニア		
クレジット属性 ( )				
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米		
その他資産		アフリカ	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
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	中近東 (中東)		
資産複合 ( )	その他 ( )	エマージング		
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(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;

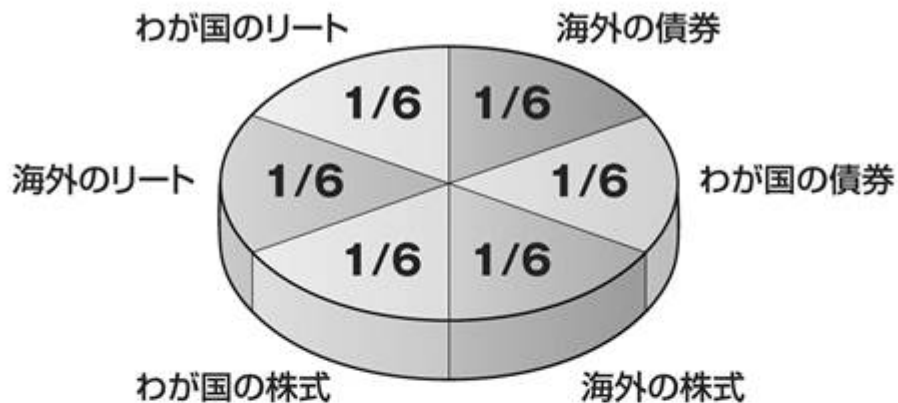
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、2,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

## &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。

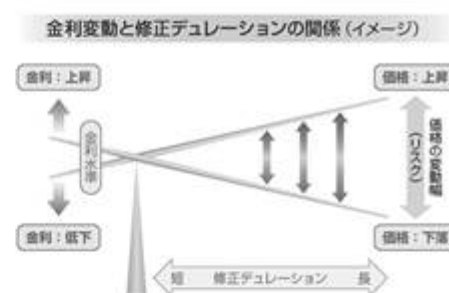
※1 ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上

※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。



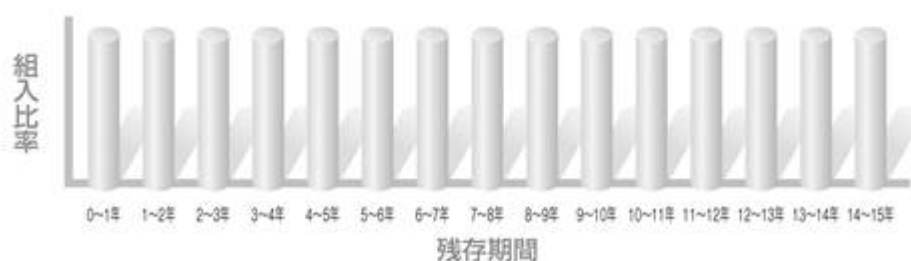
- 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建ての国債先物取引等を利用することがあります。

## 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&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。
- ・ 優先証券や大型バリュー株など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】

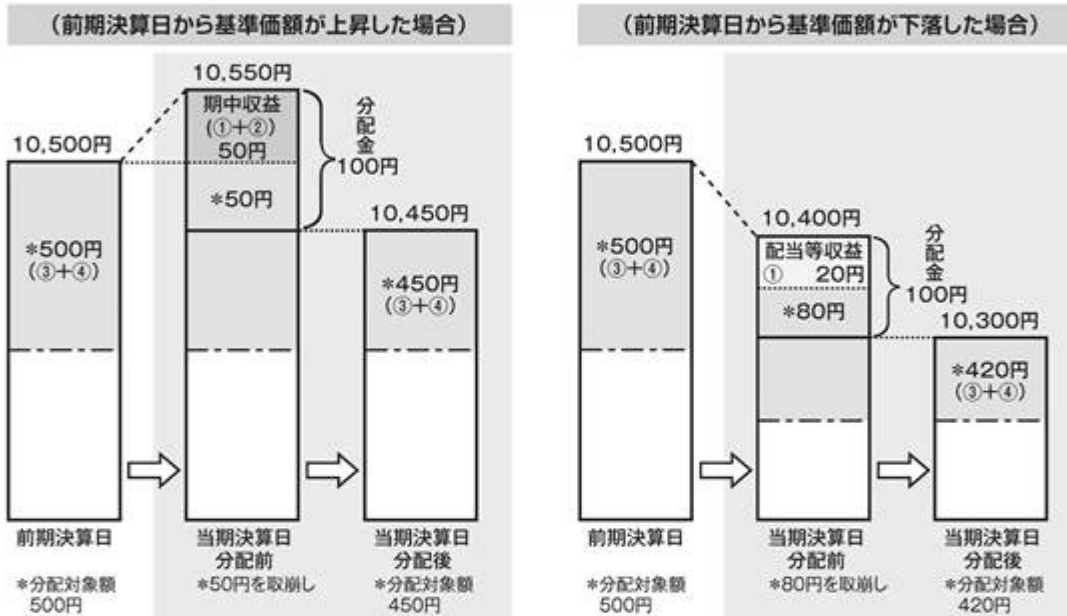
- 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

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)



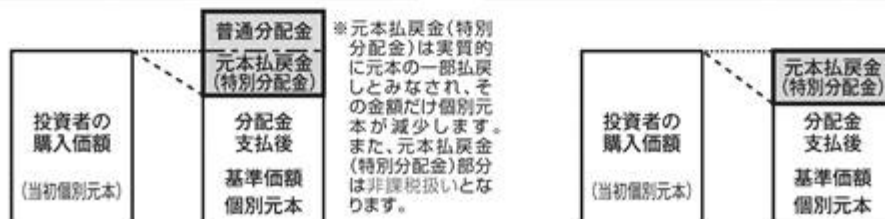
(注)分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

※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（2018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。）

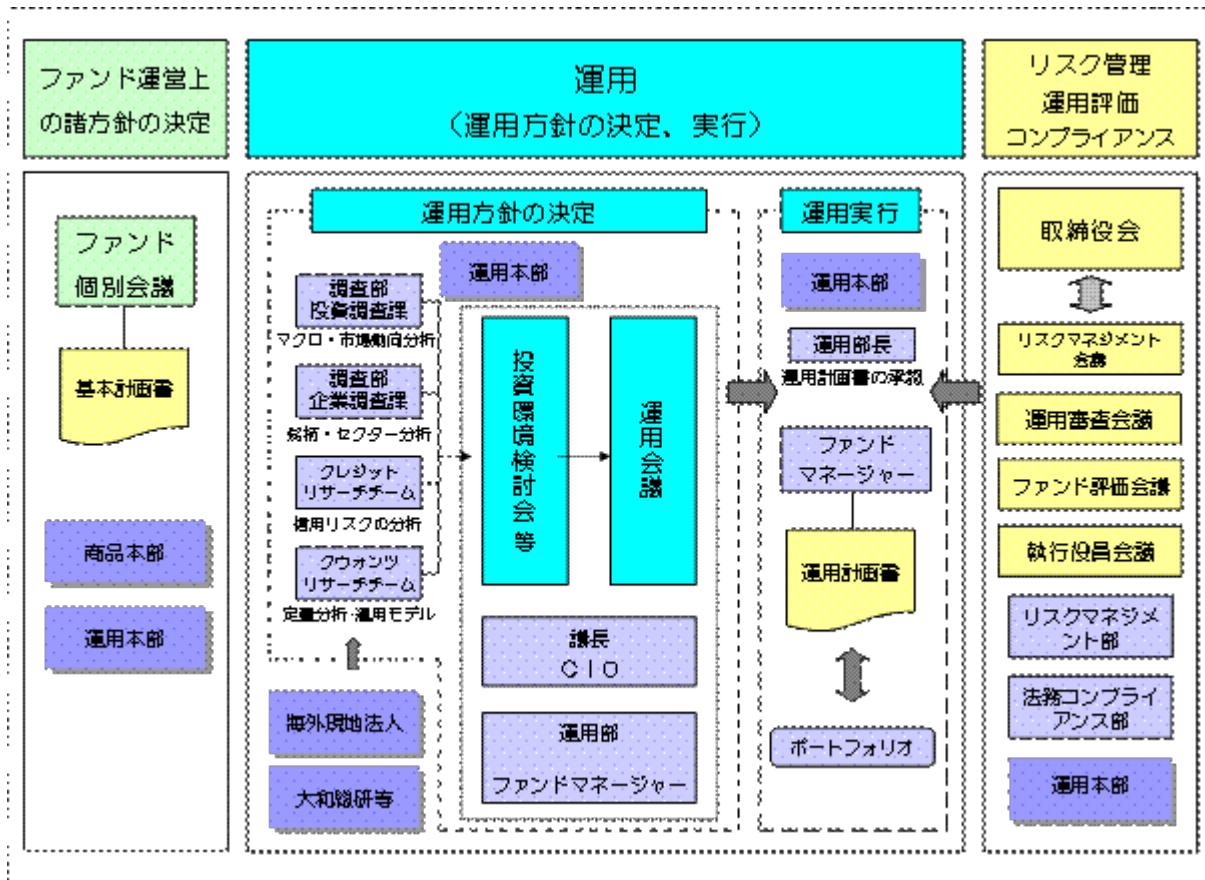
3．コール・ローン

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25~35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。

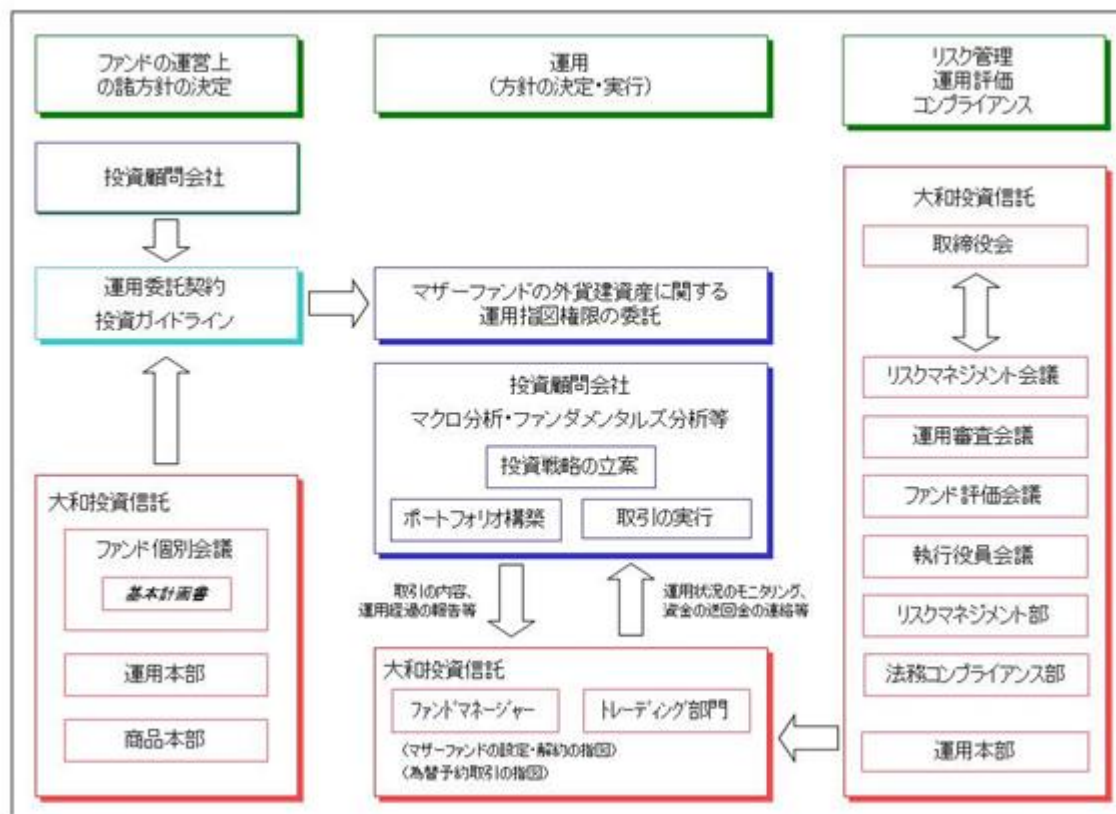
## ニ. 執行役員会議

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2018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。

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な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。

#### <参考> 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AA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ません。）
- 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. 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書
  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tock・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、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、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、

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、

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、

#### 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、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、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、

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、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、

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、

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、

## 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

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．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．預託証券（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tock・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、コーペン&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。

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 - R E I T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.（ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンドと同規定）

2.（ダイワ・グローバルR E I T・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. 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. 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。

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

### (3) 主な投資制限

～（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）

外貨建資産への直接投資は、行ないません。

## 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、

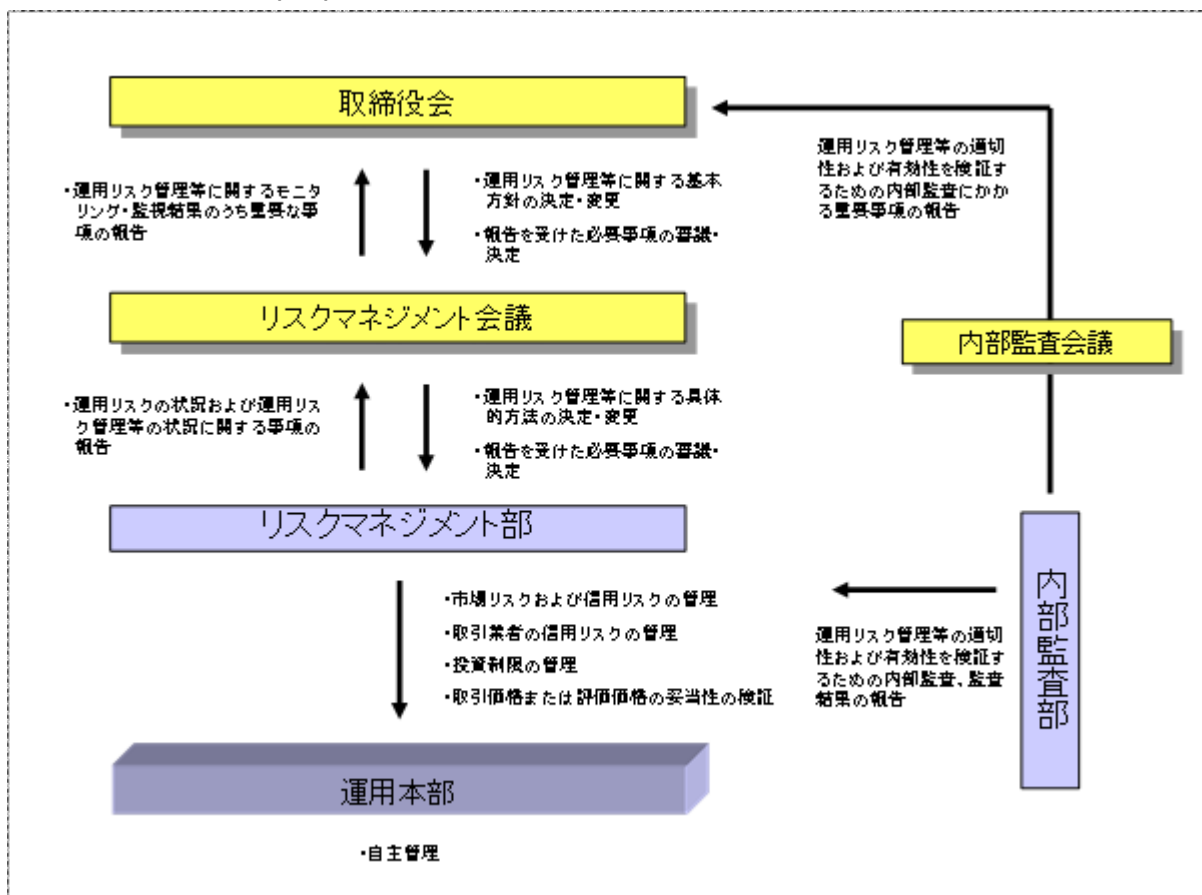
受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受付けたものとして取扱います。

### (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。



- ※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、2.7%（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1.4148%（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：N I S A（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「N I S A（ニーサ）」の適用対象です。満20歳以上の方を対象としたN I S A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N I S A」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。

- ( ) 上記は、2018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】（2018年9月28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	684,189,841	99.09
内 日本	684,189,841	99.09
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	6,316,063	0.91
純資産総額	690,505,904	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】（2018年9月28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	ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	85,684,316	1.2887 110,421,378	1.3631 116,796,291	16.91
2	ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	50,132,124	2.2312 111,859,808	2.3154 116,075,919	16.81
3	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	44,529,002	2.5143 111,959,270	2.5595 113,971,980	16.51
4	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	67,468,482	1.6552 111,680,578	1.6850 113,684,392	16.46
5	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	89,701,481	1.2508 112,207,582	1.2489 112,028,179	16.22
6	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	47,645,361	2.3428 111,623,552	2.3430 111,633,080	16.17

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。



## □．投資有価証券の種類別投資比率

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

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

## 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第6特定期間末 (2009年3月6日)	11,935,013,318	12,031,575,030	0.4944	0.4984
第7特定期間末 (2009年9月7日)	13,901,836,782	13,993,633,497	0.6057	0.6097
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
2017年9月末日	801,949,542	-	0.9412	-
10月末日	801,529,822	-	0.9536	-
11月末日	807,691,051	-	0.9663	-
12月末日	804,072,390	-	0.9790	-
2018年1月末日	782,912,488	-	0.9764	-
2月末日	759,193,260	-	0.9470	-
第24特定期間末 (2018年3月6日)	747,130,182	747,931,831	0.9320	0.9330
3月末日	741,432,616	-	0.9354	-
4月末日	736,231,740	-	0.9524	-
5月末日	718,577,874	-	0.9567	-
6月末日	717,329,733	-	0.9610	-
7月末日	693,757,597	-	0.9700	-
8月末日	690,983,811	-	0.9734	-
第25特定期間末 (2018年9月6日)	680,898,712	681,604,088	0.9653	0.9663
9月末日	690,505,904	-	0.9850	-

## 【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第6特定期間	0.0320
第7特定期間	0.0240
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

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

#### 【収益率の推移】

	収益率(%)
第6特定期間	33.4
第7特定期間	27.4
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

## (4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第6特定期間	112,127,245	875,488,163
第7特定期間	138,194,296	1,327,887,558
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

## (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 (2018年9月28日現在)

## 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	28,243,346,980	94.87

	内 ユーロ	7,298,208,880	24.52
	内 ノルウェー	651,416,391	2.19
	内 スウェーデン	591,363,114	1.99
	内 デンマーク	833,583,000	2.80
	内 イギリス	3,367,078,853	11.31
	内 ポーランド	2,116,495,633	7.11
	内 カナダ	2,644,554,549	8.88
	内 アメリカ	7,118,665,497	23.91
	内 オーストラリア	3,621,981,063	12.17
特殊債券		979,973,863	3.29
	内 カナダ	979,973,863	3.29
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		546,979,092	1.84
純資産総額		29,770,299,935	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)	453,859,134	1.52
内 日本	453,859,134	1.52
為替予約取引(売建)	449,242,000	1.51
内 日本	449,242,000	1.51

(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 (2018年9月28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	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	45,000,000	92.03 4,703,791,153	90.74 4,637,506,023	1.625000 2026/02/15	15.58
2	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	24,000,000	119.56 2,348,200,226	119.60 2,348,848,320	4.500000 2033/04/21	7.89
3	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	15,000,000	107.96 2,139,875,160	105.98 2,100,748,506	1.950000 2026/04/30	7.06
4	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	9,300,000	125.01 1,726,868,449	122.94 1,698,261,125	5.000000 2025/03/07	5.70

5	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証 券	16,000,000	100.94 1,407,577,080	99.19 1,383,147,192	2.250000 2025/06/01	4.65
6	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	10,000,000	101.61 1,342,727,396	99.65 1,316,801,528	1.400000 2028/04/30	4.42
7	Poland Government Bond	ポーランド	国債証 券	37,000,000	113.57 1,300,546,855	111.56 1,277,586,597	5.750000 2021/10/25	4.29
8	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証 券	13,500,000	95.33 1,121,651,874	93.74 1,102,980,422	1.500000 2026/06/01	3.70
9	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証 券	8,000,000	103.02 1,089,097,880	102.02 1,078,537,251	1.000000 2026/05/15	3.62
10	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	5,200,000	139.05 955,513,325	136.22 936,060,731	3.250000 2045/05/25	3.14
11	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証 券	5,300,000	133.92 937,954,033	130.77 915,900,264	5.400000 2025/03/13	3.08
12	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	8,000,000	96.61 877,823,415	95.03 863,486,338	2.250000 2025/11/15	2.90
13	Poland Government Bond	ポーランド	国債証 券	27,000,000	100.89 843,087,285	100.39 838,909,035	2.250000 2022/04/25	2.82
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	7,400,000	90.20 758,082,248	87.50 735,365,750	2.500000 2046/02/15	2.47
15	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証 券	4,500,000	101.21 676,532,613	100.75 673,411,255	1.500000 2026/07/22	2.26
16	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証 券	34,000,000	111.25 670,271,049	110.84 667,824,980	1.750000 2025/11/15	2.24
17	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証 券	6,800,000	116.85 650,204,814	116.23 646,799,376	4.750000 2027/04/21	2.17
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証 券	5,800,000	96.89 638,220,243	96.28 634,261,420	1.375000 2021/04/30	2.13
19	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証 券	7,000,000	110.76 634,495,908	109.34 626,333,366	5.750000 2021/05/15	2.10
20	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債 券	7,000,000	98.25 599,404,627	96.88 591,022,540	2.250000 2025/12/15	1.99
21	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証 券	3,500,000	101.62 528,313,040	101.43 527,320,117	1.500000 2021/01/22	1.77
22	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証 券	36,000,000	107.89 497,947,773	106.99 493,807,939	1.500000 2023/11/13	1.66
23	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証 券	2,800,000	108.01 399,639,458	107.29 396,964,416	1.500000 2023/02/15	1.33
24	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債 券	4,500,000	100.53 394,257,449	99.17 388,951,321	2.550000 2025/03/15	1.31

25	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	108.18 301,389,480	106.97 298,018,420	3.000000 2024/03/14	1.00
26	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	107.91 300,662,334	106.44 296,552,984	3.750000 2021/05/25	1.00
27	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,500,000	150.22 297,768,900	145.02 287,458,016	3.750000 2045/06/22	0.97
28	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	1,500,000	133.17 263,970,131	134.06 265,738,164	2.500000 2046/08/15	0.89
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,300,000	96.71 252,638,054	94.96 248,045,965	2.375000 2027/05/15	0.83
30	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,500,000	111.66 248,775,124	110.22 245,573,560	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。

#### □．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	94.87%
特殊債券	3.29%
合計	98.16%

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(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	スウェーデン・クローネ 買/円売 2018年10月	買建	35,402,429	443,734,000	453,859,134	1.52%
		ユーロ売/円買 2018年10 月	売建	3,400,000	443,734,000	449,242,000	1.51%

(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（2018年9月28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	258,457,032,840	99.51
内 日本	258,457,032,840	99.51
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,267,839,440	0.49
純資産総額	259,724,872,280	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（2018年9月28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	4 30年国債	日本	国債証券	13,300,000,000	134.32 17,864,908,000	131.60 17,503,199,000	2.900000 2030/11/20	6.74
2	142 20年国債	日本	国債証券	14,500,000,000	121.77 17,656,650,000	119.88 17,383,035,000	1.800000 2032/12/20	6.69
3	2 30年国債	日本	国債証券	13,870,000,000	124.76 17,304,963,000	124.63 17,287,013,200	2.400000 2030/02/20	6.66
4	1 30年国債	日本	国債証券	13,250,000,000	130.75 17,324,507,500	128.39 17,011,807,500	2.800000 2029/09/20	6.55
5	44 20年国債	日本	国債証券	16,345,000,000	104.16 17,026,101,500	103.84 16,973,792,150	2.500000 2020/03/20	6.54
6	48 20年国債	日本	国債証券	15,901,000,000	107.34 17,068,630,630	105.80 16,823,417,010	2.500000 2020/12/21	6.48
7	95 20年国債	日本	国債証券	13,105,000,000	120.32 15,768,465,000	119.16 15,616,835,350	2.300000 2027/06/20	6.01
8	6 30年国債	日本	国債証券	11,050,000,000	129.39 14,298,099,000	126.94 14,027,091,000	2.400000 2031/11/20	5.40
9	43 20年国債	日本	国債証券	13,572,000,000	104.64 14,202,820,800	102.94 13,971,288,240	2.900000 2019/09/20	5.38



10	64	20年国債	日本	国債証券	12,300,000,000	109.72 13,495,929,000	109.74 13,498,266,000	1.900000 2023/09/20	5.20
11	54	20年国債	日本	国債証券	12,387,000,000	108.80 13,477,799,220	107.39 13,302,770,910	2.200000 2021/12/20	5.12
12	70	20年国債	日本	国債証券	10,438,000,000	115.55 12,061,400,900	113.88 11,887,316,300	2.400000 2024/06/20	4.58
13	80	20年国債	日本	国債証券	10,173,000,000	115.32 11,732,290,400	114.06 11,604,239,370	2.100000 2025/06/20	4.47
14	101	20年国債	日本	国債証券	7,360,000,000	123.54 9,092,824,000	121.45 8,938,940,800	2.400000 2028/03/20	3.44
15	102	20年国債	日本	国債証券	6,700,000,000	124.15 8,318,050,000	121.95 8,171,253,000	2.400000 2028/06/20	3.15
16	86	20年国債	日本	国債証券	6,700,000,000	118.67 7,951,225,000	116.90 7,832,903,000	2.300000 2026/03/20	3.02
17	75	20年国債	日本	国債証券	4,674,000,000	115.21 5,385,320,400	113.61 5,310,318,360	2.100000 2025/03/20	2.04
18	68	20年国債	日本	国債証券	4,725,000,000	113.74 5,374,215,000	112.23 5,303,292,750	2.200000 2024/03/20	2.04
19	91	20年国債	日本	国債証券	4,300,000,000	119.64 5,144,856,000	117.81 5,066,002,000	2.300000 2026/09/20	1.95
20	88	20年国債	日本	国債証券	3,760,000,000	119.16 4,480,604,000	117.38 4,413,788,800	2.300000 2026/06/20	1.70
21	42	20年国債	日本	国債証券	3,248,000,000	102.76 3,337,644,800	101.27 3,289,379,520	2.600000 2019/03/20	1.27
22	7	30年国債	日本	国債証券	2,550,000,000	128.69 3,281,595,000	126.27 3,220,063,500	2.300000 2032/05/20	1.24
23	58	20年国債	日本	国債証券	2,825,000,000	108.59 3,067,667,500	107.86 3,047,129,750	1.900000 2022/09/20	1.17
24	59	20年国債	日本	国債証券	2,195,000,000	108.70 2,386,070,000	107.51 2,359,888,400	1.700000 2022/12/20	0.91
25	94	20年国債	日本	国債証券	1,300,000,000	118.96 1,546,480,000	117.08 1,522,092,000	2.100000 2027/03/20	0.59
26	63	20年国債	日本	国債証券	1,000,000,000	110.06 1,100,600,000	108.85 1,088,510,000	1.800000 2023/06/20	0.42
27	49	20年国債	日本	国債証券	668,000,000	106.79 713,399,200	105.46 704,492,840	2.100000 2021/03/22	0.27
28	55	20年国債	日本	国債証券	504,000,000	108.58 547,255,200	107.27 540,645,840	2.000000 2022/03/21	0.21
29	74	20年国債	日本	国債証券	265,000,000	114.68 303,907,300	113.16 299,887,250	2.100000 2024/12/20	0.12

30	111 20年国債	日本	国債証券	200,000,000	123.07 246,140,000	121.43 242,862,000	2.200000 2029/06/20	0.09
----	-----------	----	------	-------------	-----------------------	-----------------------	------------------------	------

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	99.51%
合計	99.51%

(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tock・マザーファンド

#### (1) 投資状況 (2018年9月28日現在)

##### 投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	1,570,421,651	99.29
内 中国	49,034,536	3.10
内 香港	5,012,850	0.32
内 シンガポール	3,229,919	0.20
内 ノルウェー	11,223,401	0.71
内 デンマーク	10,437,080	0.66
内 イギリス	79,204,350	5.01
内 オランダ	10,870,233	0.69
内 フランス	69,045,319	4.37
内 ドイツ	33,173,350	2.10
内 スイス	13,875,331	0.88
内 スペイン	1,076,412	0.07

内 カナダ	20,152,568	1.27
内 アメリカ	1,246,124,290	78.79
内 オーストラリア	17,962,012	1.14
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	11,175,234	0.71
純資産総額	1,581,596,885	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 (2018年9月28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	AMAZON.COM INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	330	226,551.70 74,762,063	228,614.13 75,442,666	4.77
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	情報技術	5,700	12,321.20 70,230,893	12,993.54 74,063,199	4.68
3	APPLE INC	アメリカ	株式	情報技術	2,300	25,765.62 59,260,940	25,547.57 58,759,414	3.72
4	SALESFORCE.COM INC	アメリカ	株式	情報技術	2,500	16,882.18 42,205,451	18,220.03 45,550,088	2.88
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	株式	情報技術	255	134,763.07 34,364,584	135,675.26 34,597,193	2.19
6	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	株式	金融	2,400	13,048.96 31,317,791	13,006.03 31,214,487	1.97
7	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	株式	情報技術	1,300	16,203.03 21,063,941	17,037.77 22,149,103	1.40
8	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	700	30,395.87 21,277,112	30,056.30 21,039,410	1.33
9	INTUITIVE SURGICAL INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	310	60,955.29 18,896,140	64,699.69 20,056,905	1.27
10	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	3,400	5,368.45 18,252,743	5,488.83 18,662,050	1.18
11	PFIZER INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	3,700	4,752.90 17,585,747	4,985.72 18,447,175	1.17

12	ADOBE SYSTEMS INC	アメリカ	株式	情報技術	600	29,499.69 17,699,829	30,653.67 18,392,207	1.16
13	AMERICAN EXPRESS CO	アメリカ	株式	金融	1,500	12,002.07 18,003,116	12,248.52 18,372,787	1.16
14	PALO ALTO NETWORKS INC	アメリカ	株式	情報技術	700	25,628.09 17,939,685	25,640.69 17,948,489	1.13
15	HOME DEPOT INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	700	23,366.00 16,356,254	23,490.81 16,443,573	1.04
16	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	中国	株式	金融	14,000	1,108.33 15,516,679	1,145.69 16,039,667	1.01
17	CONOCOPHILLIPS	アメリカ	株式	エネルギー	1,800	8,368.74 15,063,811	8,803.94 15,847,104	1.00
18	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,000	15,433.36 15,433,413	15,697.64 15,697,645	0.99
19	CITIGROUP INC	アメリカ	株式	金融	1,800	8,470.27 15,246,535	8,284.93 14,912,877	0.94
20	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	イギリス	株式	エネルギー	3,700	3,766.86 13,937,855	3,905.59 14,450,706	0.91
21	MASTERCARD INC - A	アメリカ	株式	情報技術	550	23,981.44 13,189,793	25,247.74 13,886,261	0.88
22	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	アメリカ	株式	資本財・サービス	700	18,437.74 12,906,472	18,779.93 13,145,955	0.83
23	TJX COMPANIES INC	アメリカ	株式	一般消費財・サービス	1,000	12,621.03 12,621,034	12,698.26 12,698,262	0.80
24	EXXON MOBIL CORP	アメリカ	株式	エネルギー	1,300	9,580.87 12,455,163	9,740.89 12,663,169	0.80
25	ILLUMINA INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	300	39,334.96 11,800,491	41,677.91 12,503,376	0.79
26	ANTHEM INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	400	30,497.51 12,199,008	30,850.15 12,340,062	0.78
27	ELI LILLY & CO	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,000	12,006.62 12,006,620	12,116.78 12,116,783	0.77
28	MERCK & CO. INC.	アメリカ	株式	ヘルスケア	1,500	7,807.48 11,711,225	8,031.67 12,047,506	0.76
29	AETNA INC	アメリカ	株式	ヘルスケア	500	22,956.13 11,478,066	23,018.36 11,509,184	0.73
30	FACEBOOK INC-A	アメリカ	株式	情報技術	600	19,039.10 11,423,495	19,175.15 11,505,095	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	99.29%
合計	99.29%

(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

業種	投資比率
エネルギー	6.11%
素材	1.41%
資本財・サービス	11.78%
一般消費財・サービス	12.07%
生活必需品	3.12%
ヘルスケア	18.27%
金融	13.96%
情報技術	30.89%
公益事業	0.79%
不動産	0.88%
合計	99.29%

(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（2018年9月28日現在）

##### 投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
株式		1,523,908,970	95.14
	内 日本	1,523,908,970	95.14

コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	77,846,224	4.86
純資産総額	1,601,755,194	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（2018年9月28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	ビジョン	日本	株式	その他製 品	11,800	5,560.00 65,608,000	6,400.00 75,520,000	4.71
2	三井化学	日本	株式	化学	23,000	2,744.00 63,112,000	2,841.00 65,343,000	4.08
3	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	91,700	670.30 61,466,510	709.10 65,024,470	4.06
4	阪和興業	日本	株式	卸売業	16,500	3,630.00 59,895,000	3,780.00 62,370,000	3.89
5	カネカ	日本	株式	化学	11,200	4,950.00 55,440,000	5,250.00 58,800,000	3.67
6	ソニー	日本	株式	電気機器	8,400	6,288.00 52,819,200	6,966.00 58,514,400	3.65
7	オリエンタルランド	日本	株式	サービ ス業	4,600	11,685.00 53,751,000	11,880.00 54,648,000	3.41
8	ヤマハ	日本	株式	その他製 品	8,700	5,380.00 46,806,000	6,020.00 52,374,000	3.27
9	大塚ホールディングス	日本	株式	医薬品	9,100	5,211.00 47,420,100	5,727.00 52,115,700	3.25
10	日本新薬	日本	株式	医薬品	6,800	6,873.14 46,737,363	7,450.00 50,660,000	3.16
11	東京海上HD	日本	株式	保険業	8,000	5,095.00 40,760,000	5,637.00 45,096,000	2.82
12	コナミホールディングス	日本	株式	情報・通 信業	9,200	4,425.00 40,710,000	4,450.00 40,940,000	2.56
13	アドバンテスト	日本	株式	電気機器	17,000	2,635.00 44,795,000	2,393.00 40,681,000	2.54

14	JSR	日本	株式	化学	19,000	2,066.00 39,254,000	2,121.00 40,299,000	2.52
15	セイコーエプソン	日本	株式	電気機器	20,400	1,833.00 37,393,200	1,938.00 39,535,200	2.47
16	ダイキン工業	日本	株式	機械	2,600	13,835.00 35,971,000	15,125.00 39,325,000	2.46
17	日本電産	日本	株式	電気機器	2,300	15,825.00 36,397,500	16,345.00 37,593,500	2.35
18	カシオ	日本	株式	電気機器	20,200	1,786.00 36,077,200	1,857.00 37,511,400	2.34
19	東海カーボン	日本	株式	ガラス・土石製品	16,000	1,994.00 31,904,000	2,231.00 35,696,000	2.23
20	ローム	日本	株式	電気機器	4,300	9,790.00 42,097,000	8,280.00 35,604,000	2.22
21	SCSK	日本	株式	情報・通信業	6,500	5,210.00 33,865,000	5,370.00 34,905,000	2.18
22	ディスコ	日本	株式	機械	1,800	18,520.00 33,336,000	19,020.00 34,236,000	2.14
23	双日	日本	株式	卸売業	79,500	383.00 30,448,500	410.00 32,595,000	2.03
24	リクルートホールディングス	日本	株式	サービス業	8,400	3,410.00 28,644,000	3,792.00 31,852,800	1.99
25	りそなホールディングス	日本	株式	銀行業	46,000	603.60 27,765,600	638.30 29,361,800	1.83
26	上新電機	日本	株式	小売業	8,700	2,856.00 24,847,200	3,350.00 29,145,000	1.82
27	村田製作所	日本	株式	電気機器	1,600	18,665.00 29,864,000	17,465.00 27,944,000	1.74
28	フジクラ	日本	株式	非鉄金属	50,000	612.00 30,600,000	537.00 26,850,000	1.68
29	グンゼ	日本	株式	繊維製品	4,500	5,590.00 25,155,000	5,720.00 25,740,000	1.61
30	バンダイナムコHLDGS	日本	株式	その他製品	5,500	4,290.00 23,595,000	4,415.00 24,282,500	1.52

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### □．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	95.14%

合計	95.14%
----	--------

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

#### 八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
食料品	0.56%
繊維製品	1.61%
化学	11.30%
医薬品	6.42%
石油・石炭製品	1.50%
ガラス・土石製品	2.23%
非鉄金属	1.68%
機械	5.68%
電気機器	19.89%
輸送用機器	2.18%
その他製品	9.50%
情報・通信業	6.24%
卸売業	6.98%
小売業	2.54%
銀行業	5.89%
保険業	2.82%
不動産業	1.29%
サービス業	6.84%
合計	95.14%

(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（2018年9月28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	95,384,611,104	95.33
内 香港	3,027,265,520	3.03
内 シンガポール	5,813,730,571	5.81
内 イギリス	8,943,236,413	8.94
内 ベルギー	1,059,054,265	1.06
内 フランス	7,653,114,297	7.65
内 ドイツ	1,010,046,864	1.01
内 スペイン	4,286,114,959	4.28
内 カナダ	2,915,153,732	2.91
内 アメリカ	47,264,311,824	47.24
内 オーストラリア	13,412,582,659	13.41
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	4,669,465,398	4.67
純資産総額	100,054,076,502	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)	72,446,313	0.07
内 日本	72,446,313	0.07
為替予約取引(売建)	242,719,007	0.24
内 日本	242,719,007	0.24

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

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

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

## (2) 投資資産 (2018年9月28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	2,719,920	1,101.37 2,995,649,170	1,112.99 3,027,265,520	3.03
2	UDR INC	アメリカ	投資証券	650,299	4,602.99 2,993,321,160	4,529.17 2,945,315,762	2.94
3	GPT GROUP	オーストラリア	投資証券	6,855,156	437.79 3,001,122,173	428.78 2,939,416,857	2.94

4	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	3,394,857	882.12 2,994,696,379	851.03 2,889,131,942	2.89
5	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	3,021,185	959.50 2,898,838,488	945.83 2,857,554,720	2.86
6	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	94,674	27,966.61 2,647,711,072	27,471.44 2,600,831,802	2.60
7	COVIVIO	フランス	投資証券	218,811	11,852.95 2,593,557,593	11,879.38 2,599,340,330	2.60
8	GECINA SA	フランス	投資証券	132,837	19,345.29 2,569,771,085	19,384.93 2,575,037,009	2.57
9	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	スペイン	投資証券	1,609,933	1,579.07 2,542,201,732	1,554.62 2,502,845,470	2.50
10	KLEPIERRE	フランス	投資証券	615,030	4,017.05 2,470,609,952	4,030.27 2,478,736,958	2.48
11	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	179,494	13,899.83 2,494,936,499	12,674.41 2,274,980,908	2.27
12	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	289,184	7,650.30 2,212,365,500	7,547.86 2,182,720,982	2.18
13	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	291,286	7,561.71 2,202,643,489	7,160.58 2,085,779,182	2.08
14	DEXUS	オーストラリア	投資証券	2,408,986	887.03 2,136,860,196	862.48 2,077,721,999	2.08
15	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	104,150	20,835.55 2,170,022,762	19,928.12 2,075,514,521	2.07
16	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	3,406,913	591.63 2,015,635,004	589.99 2,010,059,251	2.01
17	CROWN CASTLE INTL CORP	アメリカ	投資証券	159,028	12,799.33 2,035,453,282	12,370.04 1,967,183,421	1.97
18	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	171,068	11,710.20 2,003,240,955	11,337.69 1,939,516,483	1.94
19	FORTUNE REIT	シンガポール	投資証券	13,505,070	134.40 1,815,115,171	134.83 1,821,002,031	1.82
20	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	スペイン	投資証券	1,497,814	1,223.61 1,832,749,775	1,190.58 1,783,269,489	1.78
21	NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア	投資証券	13,011,386	141.56 1,841,968,569	135.42 1,762,114,441	1.76
22	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	7,063,987	243.03 1,716,796,787	245.49 1,734,138,169	1.73
23	REGENCY CENTERS CORP	アメリカ	投資証券	239,135	7,437.69 1,778,614,222	7,207.15 1,723,482,341	1.72

24	KEPPEL DC REIT	シンガポール	投資証券	14,938,013	111.23 1,661,605,975	112.89 1,686,406,064	1.69
25	APARTMENT INVT & MGMT CO - A	アメリカ	投資証券	340,128	5,030.24 1,710,954,511	4,930.07 1,676,856,107	1.68
26	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	118,394	14,424.52 1,707,777,296	13,710.17 1,623,201,914	1.62
27	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	カナダ	投資証券	403,368	3,936.56 1,587,884,553	3,759.65 1,516,522,905	1.52
28	KILROY REALTY CORP	アメリカ	投資証券	178,159	8,167.95 1,455,194,588	8,010.09 1,427,069,998	1.43
29	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	543,499	2,688.42 1,461,190,196	2,580.31 1,402,396,122	1.40
30	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	カナダ	投資証券	317,793	4,417.63 1,403,893,003	4,401.07 1,398,630,827	1.40

(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	95.33%
合計	95.33%

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

#### ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

#### 投資不動産物件

該当事項はありません。

#### その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	米ドル買/円売 2018年10月	買建	638,069	72,417,831	72,446,313	0.07%
		英ポンド売/円買 2018年10月	売建	381,707	56,694,980	56,687,346	0.06%
		米ドル売/円買 2018年10月	売建	1,500,000	169,275,000	170,310,000	0.17%

	ユーロ売/円買 2018年10月	売建	118,986	15,722,851	15,721,661	0.02%
--	------------------	----	---------	------------	------------	-------

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

(注2) 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 (2018年9月28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	103,679,730,020	98.61
内 日本	103,679,730,020	98.61
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,459,844,079	1.39
純資産総額	105,139,574,099	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 (2018年9月28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	16,489	568,545.46 9,374,746,126	596,000.00 9,827,444,000	9.35
2 野村不動産マスターF	日本	投資証券	37,517	154,500.00 5,796,376,500	155,200.00 5,822,638,400	5.54
3 オリックス不動産投資	日本	投資証券	28,644	172,515.63 4,941,537,947	177,400.00 5,081,445,600	4.83
4 大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	19,420	262,012.80 5,088,288,590	259,900.00 5,047,258,000	4.80
5 日本リテールファンド	日本	投資証券	23,606	203,667.21 4,807,768,209	206,100.00 4,865,196,600	4.63
6 日本プロロジスリート	日本	投資証券	20,899	231,100.00 4,829,758,900	224,900.00 4,700,185,100	4.47

7	日本ビルファンド	日本	投資証券	6,993	622,000.00 4,349,646,000	657,000.00 4,594,401,000	4.37
8	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	5,012	676,124.39 3,388,735,490	725,000.00 3,633,700,000	3.46
9	森ヒルズリート	日本	投資証券	22,201	139,836.39 3,104,507,907	144,400.00 3,205,824,400	3.05
10	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	42,998	70,106.08 3,014,421,371	71,900.00 3,091,556,200	2.94
11	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	16,960	172,600.00 2,927,296,000	178,300.00 3,023,968,000	2.88
12	API投資法人	日本	投資証券	5,240	485,500.00 2,544,020,000	492,000.00 2,578,080,000	2.45
13	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	8,480	283,000.00 2,399,840,000	290,200.00 2,460,896,000	2.34
14	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	14,341	167,291.44 2,399,126,568	165,200.00 2,369,133,200	2.25
15	星野リゾート・リート	日本	投資証券	4,123	559,430.09 2,306,530,282	559,000.00 2,304,757,000	2.19
16	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	27,498	81,346.36 2,236,862,400	82,700.00 2,274,084,600	2.16
17	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	5,544	404,000.00 2,239,776,000	405,000.00 2,245,320,000	2.14
18	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	4,551	452,500.00 2,059,327,500	442,500.00 2,013,817,500	1.92
19	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	8,173	231,641.07 1,893,202,537	243,300.00 1,988,490,900	1.89
20	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	39,462	49,979.13 1,972,276,433	47,500.00 1,874,445,000	1.78
21	ケネディクス・レジデンシャル・ネットワーク投資法人	日本	投資証券	10,714	161,640.92 1,731,820,900	173,900.00 1,863,164,600	1.77
22	プレミア投資法人	日本	投資証券	15,023	107,391.67 1,613,345,120	119,400.00 1,793,746,200	1.71
23	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,580	631,000.00 1,627,980,000	685,000.00 1,767,300,000	1.68
24	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	18,497	85,700.00 1,585,192,900	89,800.00 1,661,030,600	1.58
25	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	3,179	481,000.00 1,529,099,000	506,000.00 1,608,574,000	1.53
26	GLP投資法人	日本	投資証券	14,491	118,300.00 1,714,285,300	110,500.00 1,601,255,500	1.52

27	日本リート投資法人	日本	投資証券	4,297	329,855.03 1,417,387,100	367,500.00 1,579,147,500	1.50
28	三井不ロジパーク	日本	投資証券	4,708	332,014.91 1,563,126,212	319,000.00 1,501,852,000	1.43
29	MCUBS MidCity投資法人	日本	投資証券	16,418	83,000.00 1,362,694,000	86,400.00 1,418,515,200	1.35
30	森トラスト総合リート	日本	投資証券	7,939	161,900.00 1,285,324,100	162,000.00 1,286,118,000	1.22

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

#### ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	98.61%
合計	98.61%

(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)

2018年9月28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	9,850円
純資産総額	6.9億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	1.3%
3カ月間	2.8%
6カ月間	6.0%
1年間	6.0%
3年間	14.1%
5年間	39.1%
設定来	64.2%



※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: 4,065円

決算期	第136期	第137期	第138期	第139期	第140期	第141期	第142期	第143期	第144期	第145期	第146期	第147期
	17年10月	17年11月	17年12月	18年1月	18年2月	18年3月	18年4月	18年5月	18年6月	18年7月	18年8月	18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。

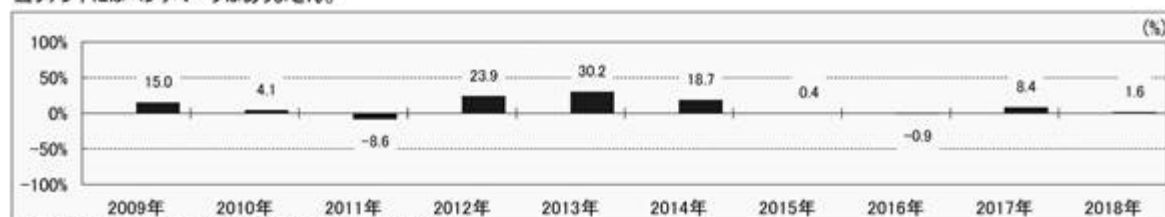
資産別構成	銘柄数	比率	通貨別構成	比率	債券ポートフォリオ特性値	組入上位銘柄	国・地域名	比率	
外国株式	199	16.7%	日本円	50.7%	直接利回り(%)	AMAZON.COM INC	アメリカ	0.8%	
国内リート	53	16.3%	米ドル	25.2%	最終利回り(%)	ビジョン	日本	0.8%	
外国債券	35	16.2%	ユーロ	7.5%	修正デュレーション	MICROSOFT CORP	アメリカ	0.8%	
国内債券	31	16.1%	豪ドル	4.5%	残存年数	三井化学	日本	0.7%	
国内株式	44	16.1%	英ポンド	4.2%	債券格付別構成	三菱UFJフィナンシャルG	日本	0.7%	
外国リート	68	15.4%	カナダドル	2.7%	AAA	87.1%	ジャパンリアルエステイト	日本	1.5%
			香港ドル	1.4%	AA	5.9%	野村不動産マスターF	日本	0.9%
			ポーランド・ズロチ	1.2%	A	7.0%	オリックス不動産投資	日本	0.8%
			シンガポール・ドル	0.7%	BBB	-	大和ハウスリート投資法人	日本	0.8%
コール・ローン、その他		3.2%	その他	1.8%	BB	-	日本リートファンド	日本	0.8%
合計	430	100.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	8.6%	

※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。

※2018年は9月28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 <http://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 <http://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 <http://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。  
<http://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、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、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(平成30年3月7日から平成30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 平成30年3月6日現在	当 期 平成30年9月6日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	10,332,719	8,837,102
親投資信託受益証券	738,447,432	674,729,296
未収入金	-	2,000,000
流動資産合計	748,780,151	685,566,398
資産合計	748,780,151	685,566,398
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払収益分配金	801,649	705,376
未払解約金	-	3,107,084
未払受託者報酬	31,153	31,517
未払委託者報酬	785,237	794,381
その他未払費用	31,930	29,328
流動負債合計	1,649,969	4,667,686
負債合計	1,649,969	4,667,686
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 801,649,646	1 705,376,655
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	2 54,519,464	2 24,477,943
(分配準備積立金)	22,603,648	22,187,900
元本等合計	747,130,182	680,898,712
純資産合計	747,130,182	680,898,712
負債純資産合計	748,780,151	685,566,398

## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自	平成29年9月7日 至 平成30年3月6日	自	平成30年3月7日 至 平成30年9月6日
営業収益				
有価証券売買等損益		23,825,080		35,281,864
営業収益合計		23,825,080		35,281,864
営業費用				
支払利息		2,019		2,586
受託者報酬		213,440		195,951
委託者報酬		1 5,379,724		1 4,938,946
その他費用		31,930		29,851
営業費用合計		5,627,113		5,167,334
営業利益		18,197,967		30,114,530
経常利益		18,197,967		30,114,530
当期純利益		18,197,967		30,114,530
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		467,164		98,928
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		69,932,301		54,519,464
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,645,479		4,489,154
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,645,479		4,489,154
剰余金減少額又は欠損金増加額		14,527		12,167
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		14,527		12,167
分配金		2 4,948,918		2 4,451,068
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		54,519,464		24,477,943



## (3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 平成30年3月7日	至 平成30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
	平成30年3月6日現在	平成30年9月6日現在
1. 1 期首元本額	864,920,076円	801,649,646円
期中追加設定元本額	309,332円	259,333円
期中一部解約元本額	63,579,762円	96,532,324円
2. 特定期間末日における受益権の総数	801,649,646口	705,376,655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54,519,464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24,477,943円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	自 平成29年9月7日 至 平成30年3月6日	自 平成30年3月7日 至 平成30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	312,966円	296,357円

## 2. 2 分配金の計算過程

(自平成29年9月7日 至平成29年10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(2,131,729円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,638,793円)及び分配準備積立金(22,017,874円)より分配対象額は28,788,396円(1万口当たり338.22円)であり、うち851,174円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自平成29年10月7日 至平成29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(1,085,048円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,578,471円)及び分配準備積立金(22,986,275円)より分配対象額は28,649,794円(1万口当たり341.14円)であり、うち839,825円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自平成30年3月7日 至平成30年4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(2,122,264円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,263,922円)及び分配準備積立金(22,017,749円)より分配対象額は28,403,935円(1万口当たり363.73円)であり、うち780,914円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

(自平成30年4月7日 至平成30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(1,074,703円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,221,070円)及び分配準備積立金(23,115,580円)より分配対象額は28,411,353円(1万口当たり367.63円)であり、うち772,817円(1万口当たり10円)を分配金額としております。

<p>(自平成29年11月7日 至平成29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(725,412円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,551,239円)及び分配準備積立金(23,084,232円)より分配対象額は28,360,883円(1万口当たり339.83円)であり、うち834,554円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成30年5月8日 至平成30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(1,307,569円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,103,844円)及び分配準備積立金(22,758,598円)より分配対象額は28,170,011円(1万口当たり375.04円)であり、うち751,116円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>
<p>(自平成29年12月7日 至平成30年1月9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(1,943,894円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,472,732円)及び分配準備積立金(22,569,850円)より分配対象額は28,986,476円(1万口当たり353.54円)であり、うち819,886円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>	<p>(自平成30年6月7日 至平成30年7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(892,998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(3,965,995円)及び分配準備積立金(22,523,383円)より分配対象額は27,382,376円(1万口当たり377.35円)であり、うち725,652円(1万口当たり10円)を分配金額としております。</p>

<p>（自平成30年1月10日 至平成30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（230,501円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,375,525円）及び分配準備積立金（23,170,769円）より分配対象額は27,776,795円（1万口当たり346.42円）であり、うち801,830円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成30年7月7日 至平成30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（753,300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（3,910,131円）及び分配準備積立金（22,362,377円）より分配対象額は27,025,808円（1万口当たり377.88円）であり、うち715,193円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成30年2月7日 至平成30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（812,207円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（4,375,805円）及び分配準備積立金（22,593,090円）より分配対象額は27,781,102円（1万口当たり346.55円）であり、うち801,649円（1万口当たり10円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成30年8月7日 至平成30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（801,571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（3,857,771円）及び分配準備積立金（22,091,705円）より分配対象額は26,751,047円（1万口当たり379.24円）であり、うち705,376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 平成30年3月7日 至 平成30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
	平成30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
	平成30年3月6日現在	平成30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	7,180,209	774,432
合計	7,180,209	774,432

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期 平成30年3月6日現在	当 期 平成30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 平成30年3月7日 至 平成30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 平成30年3月6日現在	当 期 平成30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)	0.9320円 (9,320円)	0.9653円 (9,653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	68,069,336	112,675,171	
	ダイワ日本国債マザーファンド	90,501,290	113,208,063	
	ダイワ・グローバルREIT・マザー ファンド	48,068,749	112,615,465	

	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	44,925,497	112,956,177	
	ダイワ日本ハーモニースtock・マザーファンド	85,684,316	110,421,378	
	ダイワ外国ハーモニースtock・マザーファンド	50,577,261	112,853,042	
親投資信託受益証券 合計			674,729,296	
合計			674,729,296	

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J-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

	平成30年3月6日現在	平成30年9月6日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	126,993,531	74,060,878
コール・ローン	98,053,320	51,098,985
国債証券	29,054,313,311	27,956,189,221
特殊債券	933,673,726	960,313,321
派生商品評価勘定	19,563,000	10,519,627

未収入金		105,061,400	42,350,880
未収利息		339,471,567	278,150,743
前払費用		9,893,643	-
差入委託証拠金		128,681,612	130,450,192
流動資産合計		30,815,705,110	29,503,133,847
資産合計		30,815,705,110	29,503,133,847
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		45,828,299	10,989,756
未払解約金		23,768,080	55,508,066
その他未払費用		-	118
流動負債合計		69,596,379	66,497,940
負債合計		69,596,379	66,497,940
純資産の部			
元本等			
元本	1	18,884,213,504	17,783,750,156
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		11,861,895,227	11,652,885,751
元本等合計		30,746,108,731	29,436,635,907
純資産合計		30,746,108,731	29,436,635,907
負債純資産合計		30,815,705,110	29,503,133,847

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年3月7日 至 平成30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	平成30年3月6日現在	平成30年9月6日現在
1. 1 期首	平成29年9月7日	平成30年3月7日
期首元本額	20,212,051,847円	18,884,213,504円
期中追加設定元本額	541,115,170円	240,102,895円
期中一部解約元本額	1,868,953,513円	1,340,566,243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）	1,868,902,489円	1,793,320,690円
富山応援ファンド（地域企業株・外債バランスノ毎月分配型）	676,574,075円	659,024,327円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	1,042,316,019円	967,622,734円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	50,538,318円	49,937,427円

安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	205,736,425円	190,129,194円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	374,133,301円	355,441,989円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	568,460,329円	523,169,111円
京都応援バランスファンド(隔月分配型)	245,555,367円	234,679,109円
6資産バランスファンド(分配型)	1,179,001,009円	1,130,017,321円
6資産バランスファンド(成長型)	127,395,015円	125,596,441円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(毎月分配型)	8,161,645,468円	7,636,222,674円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	75,947,715円	68,069,336円
ダイワ外債ソブリン・ファンド(毎月分配型)	370,618,183円	337,110,244円
兵庫応援バランスファンド(毎月分配型)	1,020,807,739円	954,476,350円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	27,147,696円	25,095,750円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	296,837,260円	273,961,713円
紀陽地域株式・外債バランスファンド(隔月分配型)	56,186,135円	-円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	1,191,104,866円	1,116,853,115円
ダイワ海外ソブリン・ファンド(1年決算型)	16,971,374円	15,413,469円
四国アライアンス 地域創生ファンド(年1回決算型)	896,738,464円	895,393,175円
四国アライアンス 地域創生ファンド(年2回決算型)	431,596,257円	432,215,987円
計	18,884,213,504円	17,783,750,156円
2. 期末日における受益権の総数	18,884,213,504口	17,783,750,156口

(金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年3月7日 至 平成30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	平成30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	平成30年3月6日現在	平成30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	403,131,620	111,274,401
特殊債券	5,306,813	2,450,027
合計	408,438,433	113,724,428

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年10月11日から平成30年3月6日まで、及び平成30年4月11日から平成30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	平成30年3月6日 現在				平成30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	1,727,086,000	-	1,707,523,000	19,563,000	1,294,029,777	-	1,304,663,756	10,633,979
アメリカ・ドル	-	-	-	-	22,293,200	-	22,250,000	43,200
オーストラリア ・ドル	1,214,665,000	-	1,195,960,000	18,705,000	-	-	-	-
スウェーデン・ クローナ	-	-	-	-	427,563,577	-	427,911,756	348,179
ユーロ	512,421,000	-	511,563,000	858,000	844,173,000	-	854,502,000	10,329,000
買 建	1,727,086,000	-	1,681,257,701	45,828,299	1,271,736,577	-	1,281,900,427	10,163,850
カナダ・ドル	1,214,665,000	-	1,179,145,902	35,519,098	-	-	-	-

スウェーデン・ クローナ	512,421,000	-	502,111,799	10,309,201	844,173,000	-	854,649,427	10,476,427
ユーロ	-	-	-	-	427,563,577	-	427,251,000	312,577
合計	3,454,172,000	-	3,388,780,701	26,265,299	2,565,766,354	-	2,586,564,183	470,129

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## (1口当たり情報)

	平成30年3月6日現在	平成30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)	1.6281円 (16,281円)	1.6553円 (16,553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 7,689,360.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	45,000,000.000	41,308,200.000	

	2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	7,400,000.000	6,613,158.000	
	1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	5,800,000.000	5,604,250.000	
	2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	2,300,000.000	2,210,691.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 63,425,659.000 (7,056,738,820)	
イギリス・ポンド	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	3,500,000.000	3,557,400.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	4,500,000.000	4,575,690.000	
	5% United Kingdom Gilt 20250307	9,300,000.000	11,534,418.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	1,530,400.000	
	4% United Kingdom Gilt 20220307	1,500,000.000	1,662,030.000	
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 22,859,938.000 (3,286,116,088)	
オーストラリア・ドル	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	7,000,000.000	7,682,710.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	6,800,000.000	7,981,160.000	
	4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	24,000,000.000	29,145,600.000	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 44,809,470.000 (3,586,998,074)	
カナダ・ドル	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,500,000.000	1,871,955.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	16,500,000.000	16,555,935.000	

	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	13,500,000.000	12,816,090.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 31,243,980.000 (2,638,241,672)	
スウェーデン・ クローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	6,800,000.000	7,640,344.000	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	36,000,000.000	38,800,800.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 46,441,144.000 (570,761,660)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,500,000.000	9,454,720.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	34,000,000.000	38,052,120.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 47,506,840.000 (825,193,810)	
ノルウェー・ク ローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	23,000,000.000	24,579,180.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	4,000,000.000	4,106,000.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	20,000,000.000	21,574,600.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 50,259,780.000 (665,942,085)	
ポーランド・ズ ロチ	2.25% Poland Government Bond 20220425	27,000,000.000	27,070,200.000	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	39,000,000.000	43,592,250.000	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ	

				70,662,450.000 (2,115,633,753)
	ユーロ		ユーロ	ユーロ
		1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	2,800,000.000	3,023,916.000
		2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,500,000.000	2,040,555.000
		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	5,200,000.000	7,180,992.000
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,500,000.000	2,197,800.000
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	5,300,000.000	7,003,844.000
		1% IRISH TREASURY 20260515	8,000,000.000	8,245,120.000
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	15,000,000.000	15,986,400.000
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	10,000,000.000	10,014,300.000
	ユーロ 小計			ユーロ 55,692,927.000 (7,210,563,259)
国債証券 合計				27,956,189,221 [27,956,189,221]
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	4,508,460.000
		2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	7,000,000.000	6,864,270.000
	カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 11,372,730.000 (960,313,321)
特殊債券 合計				960,313,321 [960,313,321]
合計				28,916,502,542 [28,916,502,542]

- (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%	24.4%
イギリス・ポンド	国債証券	5銘柄	100%	11.4%
オーストラリア・ドル	国債証券	3銘柄	100%	12.4%
カナダ・ドル	国債証券 特殊債券	3銘柄 2銘柄	100%	12.4%
スウェーデン・クローナ	国債証券	2銘柄	100%	2.0%
デンマーク・クローネ	国債証券	2銘柄	100%	2.9%
ノルウェー・クローネ	国債証券	3銘柄	100%	2.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券	2銘柄	100%	7.3%
ユーロ	国債証券	8銘柄	100%	24.9%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 「ダイワ日本国債マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成30年3月6日現在	平成30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	905,520,952	36,124,997
国債証券	298,312,940,220	262,227,601,160
未収入金	-	1,360,326,000
未収利息	2,037,965,823	1,787,624,407
前払費用	36,156,278	52,343,273
流動資産合計	301,292,583,273	265,464,019,837
資産合計	301,292,583,273	265,464,019,837
負債の部		
流動負債		
未払解約金	145,747,375	161,875,108
その他未払費用	-	2,619
流動負債合計	145,747,375	161,877,727
負債合計	145,747,375	161,877,727

純資産の部		
元本等		
元本	1	240,018,140,954
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		61,128,694,944
元本等合計		301,146,835,898
純資産合計		301,146,835,898
負債純資産合計		301,292,583,273
		212,095,705,833
		53,206,436,277
		265,302,142,110
		265,302,142,110
		265,464,019,837

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成30年3月7日 至 平成30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た価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年3月6日現在	平成30年9月6日現在
1. 1 期首	平成29年9月7日	平成30年3月7日
期首元本額	269,477,775,620円	240,018,140,954円
期中追加設定元本額	2,050,379,380円	1,206,355,327円
期中一部解約元本額	31,510,014,046円	29,128,790,448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	6,786,270円	6,741,216円
（適格機関投資家専用）		

安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	275,615,776円	250,897,485円
6資産バランスファンド（分配型）	314,431,042円	296,107,806円
6資産バランスファンド（成長型）	170,997,055円	165,422,344円
ダイワ日本国債ファンド（毎月分配型）	228,047,519,468円	200,439,072,532円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	103,243,713円	90,501,290円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	52,450,487円	45,281,449円
ダイワ日本国債ファンド（年1回決算型）	10,794,121,356円	10,569,672,528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）	252,975,787円	232,009,183円
計	240,018,140,954円	212,095,705,833円
2. 期末日における受益権の総数	240,018,140,954口	212,095,705,833口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年3月7日 至 平成30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	平成30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	平成30年3月6日現在	平成30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	3,779,540,890	3,303,433,320
合計	3,779,540,890	3,303,433,320

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成29年3月11日から平成30年3月6日まで、及び平成30年3月13日から平成30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

平成30年3月6日現在	平成30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)

	平成30年3月6日現在	平成30年9月6日現在
1口当たり純資産額	1.2547円	1.2509円
(1万口当たり純資産額)	(12,547円)	(12,509円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額 (円)	評価額 (円)	備考
国債証券	1 30年国債	13,250,000,000	17,061,760,000	
	2 30年国債	470,000,000	587,763,200	
	4 30年国債	13,300,000,000	17,577,546,000	
	6 30年国債	11,050,000,000	14,086,319,000	
	7 30年国債	2,550,000,000	3,231,666,000	
	40 20年国債	7,802,000,000	7,808,631,700	
	42 20年国債	9,548,000,000	9,686,350,520	
	43 20年国債	13,572,000,000	13,996,939,320	
	44 20年国債	3,245,000,000	3,375,416,550	
	48 20年国債	15,901,000,000	16,852,674,850	
	49 20年国債	668,000,000	705,461,440	
	52 20年国債	3,268,000,000	3,487,086,720	
	54 20年国債	12,387,000,000	13,323,704,940	
	55 20年国債	504,000,000	541,442,160	
	56 20年国債	200,000,000	215,828,000	
	58 20年国債	12,625,000,000	13,637,020,000	
	59 20年国債	2,595,000,000	2,793,595,350	
	63 20年国債	1,000,000,000	1,089,750,000	
	68 20年国債	4,725,000,000	5,313,215,250	
	70 20年国債	10,438,000,000	11,914,350,720	
	74 20年国債	265,000,000	300,446,400	
	75 20年国債	4,674,000,000	5,322,003,360	
	80 20年国債	10,173,000,000	11,633,944,530	
	82 20年国債	1,665,000,000	1,911,669,750	
	83 20年国債	2,900,000,000	3,342,424,000	
	86 20年国債	6,700,000,000	7,854,678,000	
	88 20年国債	3,760,000,000	4,426,196,800	
91 20年国債	6,000,000,000	7,088,940,000		
94 20年国債	1,300,000,000	1,526,395,000		
95 20年国債	7,405,000,000	8,854,306,600		

101	20年国債	7,860,000,000	9,575,838,000	
102	20年国債	6,700,000,000	8,193,028,000	
106	20年国債	7,280,000,000	8,790,236,000	
111	20年国債	7,100,000,000	8,653,693,000	
142	20年国債	14,500,000,000	17,467,280,000	
国債証券 合計			262,227,601,160	
合計			262,227,601,160	

## 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

	平成30年3月6日現在	平成30年9月6日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	7,710,409	-
コール・ローン	1,120,042	2,745,835
株式	1,507,346,383	1,507,952,449
派生商品評価勘定	-	3,275
未収入金	30,597,206	43,515,214
未収配当金	2,282,528	2,565,643
流動資産合計	1,549,056,568	1,556,782,416
資産合計	1,549,056,568	1,556,782,416
負債の部		
流動負債		
前受金	-	21,442,605
未払金	7,148,677	10,073,912
未払解約金	-	1,000,000
その他未払費用	-	3
流動負債合計	7,148,677	32,516,520
負債合計	7,148,677	32,516,520

純資産の部		
元本等		
元本	1	755,812,942
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		786,094,949
元本等合計		1,541,907,891
純資産合計		1,541,907,891
負債純資産合計		1,549,056,568
		683,129,921
		841,135,975
		1,524,265,896
		1,524,265,896
		1,556,782,416

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年3月7日 至 平成30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> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>
----------------------------	---

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年3月6日現在	平成30年9月6日現在
1. 1 期首	平成29年9月7日	平成30年3月7日
期首元本額	868,837,326円	755,812,942円
期中追加設定元本額	4,148,733円	3,951,002円
期中一部解約元本額	117,173,117円	76,634,023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）	184,318,058円	167,892,440円
6 資産バランスファンド（成		
長型）	511,687,520円	464,660,220円
世界 6 資産均等分散ファンド		
（毎月分配型）	59,807,364円	50,577,261円
計	755,812,942円	683,129,921円
2. 期末日における受益権の総数	755,812,942口	683,129,921口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年3月7日 至 平成30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	平成30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	平成30年3月6日現在	平成30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	124,859,693	127,276,623
合計	124,859,693	127,276,623

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成29年9月7日から平成30年3月6日まで、及び平成30年3月7日から平成30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	平成30年3月6日 現在				平成30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	-	-	-	-	2,783,775	-	2,780,500	3,275
アメリカ・ドル	-	-	-	-	2,783,775	-	2,780,500	3,275
合計	-	-	-	-	2,783,775	-	2,780,500	3,275

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

## （1口当たり情報）

	平成30年3月6日現在	平成30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）	2,0401円 (20,401円)	2,2313円 (22,313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	400	222.230	88,892.000	
	ABBOTT LABORATORIES	1,300	66.000	85,800.000	
	VERISK ANALYTICS INC	800	120.060	96,048.000	
	AFLAC INC	1,100	47.080	51,788.000	
	ADOBE SYSTEMS INC	450	256.140	115,263.000	
	AETNA INC	400	201.930	80,772.000	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	500	161.790	80,895.000	
	CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	200	63.400	12,680.000	
	AUTODESK INC	300	149.330	44,799.000	
	MOODY'S CORP	100	176.100	17,610.000	
	CITIGROUP INC	100	71.170	7,117.000	
	AUTOMATIC DATA PROCESSING	200	146.140	29,228.000	
	DANAHER CORP	200	104.010	20,802.000	
	INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	700	76.710	53,697.000	
	APPLE INC	2,300	226.870	521,801.000	
	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	500	78.530	39,265.000	
	BOEING CO/THE	225	346.680	78,003.000	
	BECTON DICKINSON AND CO	300	257.580	77,274.000	
	JPMORGAN CHASE & CO	2,500	114.590	286,475.000	
	SERVICENOW INC	900	190.760	171,684.000	
	CATERPILLAR INC	50	140.590	7,029.500	
	CISCO SYSTEMS INC	3,400	47.270	160,718.000	
MORGAN STANLEY	100	48.720	4,872.000		
MSCI INC	300	178.520	53,556.000		
BROADCOM INC	50	221.420	11,071.000		

ULTIMATE SOFTWARE GROUP INC	200	306.610	61,322.000
SPLUNK INC	400	121.930	48,772.000
NASDAQ INC	600	94.500	56,700.000
VAIL RESORTS INC	250	289.730	72,432.500
WELLCARE HEALTH PLANS INC	100	305.410	30,541.000
AMETEK INC	1,000	78.000	78,000.000
ACTIVISION BLIZZARD INC	200	71.650	14,330.000
COSTAR GROUP INC	100	442.510	44,251.000
SVB FINANCIAL GROUP	300	325.730	97,719.000
HCA HEALTHCARE INC	700	133.790	93,653.000
COCA-COLA CO/THE	100	45.380	4,538.000
CSX CORP	700	74.300	52,010.000
AMAZON.COM INC	360	1,994.820	718,135.200
EXXON MOBIL CORP	300	81.360	24,408.000
EOG RESOURCES INC	500	117.890	58,945.000
NEXTERA ENERGY INC	600	171.620	102,972.000
UNITED RENTALS INC	200	156.620	31,324.000
FISERV INC	1,200	79.710	95,652.000
ALPHABET INC-CL C	370	1,186.480	438,997.600
IHS MARKIT LTD	900	55.030	49,527.000
HOME DEPOT INC	500	204.150	102,075.000
HUMANA INC	200	332.880	66,576.000
ZOETIS INC	1,100	89.060	97,966.000
JOHNSON & JOHNSON	1,000	135.860	135,860.000
LOCKHEED MARTIN CORP	50	321.330	16,066.500
LOWE'S COS INC	500	108.410	54,205.000
ELI LILLY & CO	1,000	105.720	105,720.000
MCDONALD'S CORP	50	163.240	8,162.000
3M CO	100	211.830	21,183.000
FACEBOOK INC-A	500	167.180	83,590.000
S&P GLOBAL INC	200	204.990	40,998.000
PHILLIPS 66	500	117.990	58,995.000
MERCK & CO. INC.	1,200	68.620	82,344.000
DOWDUPONT INC	300	70.050	21,015.000
WORKDAY INC-CLASS A	300	142.210	42,663.000
SQUARE INC - A	800	87.200	69,760.000
TRANSUNION	500	75.340	37,670.000
NETAPP INC	500	83.320	41,660.000
NIKE INC -CL B	1,100	79.920	87,912.000

MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	300	60.390	18,117.000	
PFIZER INC	3,700	41.850	154,845.000	
STRYKER CORP	150	168.040	25,206.000	
CONOCOPHILLIPS	1,300	73.000	94,900.000	
PEPSICO INC	100	113.120	11,312.000	
ACCENTURE PLC-CL A	450	168.640	75,888.000	
RAYTHEON COMPANY	50	198.030	9,901.500	
RED HAT INC	300	144.280	43,284.000	
REPUBLIC SERVICES INC	1,100	73.980	81,378.000	
ROSS STORES INC	800	97.460	77,968.000	
REGIONS FINANCIAL CORP	1,300	19.930	25,909.000	
CHEVRON CORP	400	118.920	47,568.000	
TESLA INC	25	280.740	7,018.500	
CBRE GROUP INC - A	900	47.160	42,444.000	
TEXAS INSTRUMENTS INC	400	111.130	44,452.000	
SALESFORCE.COM INC	2,800	148.650	416,220.000	
UNION PACIFIC CORP	400	154.170	61,668.000	
MARATHON PETROLEUM CORP	400	83.940	33,576.000	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	200	132.780	26,556.000	
UNITEDHEALTH GROUP INC	700	267.640	187,348.000	
VALERO ENERGY CORP	500	116.910	58,455.000	
ANTHEM INC	300	267.850	80,355.000	
WALT DISNEY CO/THE	800	109.870	87,896.000	
WELLS FARGO & CO	1,800	58.950	106,110.000	
WASTE MANAGEMENT INC	900	91.540	82,386.000	
WALMART INC	400	96.620	38,648.000	
TJX COMPANIES INC	1,000	111.130	111,130.000	
ALLERGAN PLC	200	191.240	38,248.000	
VISA INC-CLASS A SHARES	1,300	142.670	185,471.000	
NORTHERN TRUST CORP	100	106.990	10,699.000	
NVIDIA CORP	400	278.420	111,368.000	
NETFLIX INC	150	341.180	51,177.000	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	350	236.370	82,729.500	
MASTERCARD INC - A	550	211.160	116,138.000	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	300	128.900	38,670.000	
BANK OF AMERICA CORP	3,600	31.180	112,248.000	
AMERICAN EXPRESS CO	1,700	105.680	179,656.000	

ANALOG DEVICES INC	200	97.870	19,574.000	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	200	57.730	11,546.000	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	500	120.840	60,420.000	
EMERSON ELECTRIC CO	600	77.270	46,362.000	
AMGEN INC	300	197.750	59,325.000	
TAPESTRY INC	800	50.430	40,344.000	
CME GROUP INC	400	171.290	68,516.000	
EQUIFAX INC	500	134.540	67,270.000	
SUNTRUST BANKS INC	1,200	74.450	89,340.000	
SCHWAB (CHARLES) CORP	300	50.520	15,156.000	
BAXTER INTERNATIONAL INC	700	74.070	51,849.000	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	100	99.850	9,985.000	
CITRIX SYSTEMS INC	700	112.380	78,666.000	
INTEL CORP	1,400	47.720	66,808.000	
ILLUMINA INC	300	346.350	103,905.000	
INTUITIVE SURGICAL INC	310	536.720	166,383.200	
COMERICA INC	200	97.980	19,596.000	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	300	67.300	20,190.000	
MICROSOFT CORP	6,300	108.490	683,487.000	
MEDTRONIC PLC	900	96.040	86,436.000	
MICRON TECHNOLOGY INC	200	49.540	9,908.000	
BLACKROCK INC	20	478.240	9,564.800	
KANSAS CITY SOUTHERN	100	117.120	11,712.000	
PAYPAL HOLDINGS INC	900	89.050	80,145.000	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	1,000	89.830	89,830.000	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	100	137.750	13,775.000	
E*TRADE FINANCIAL CORP	100	58.260	5,826.000	
BIOGEN INC	50	346.600	17,330.000	
IDEXX LABORATORIES INC	100	245.650	24,565.000	
INTUIT INC	350	218.690	76,541.500	
BEST BUY CO INC	500	79.070	39,535.000	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,900	35.750	67,925.000	
アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 10,734,548.300 (1,194,325,844)	
イギリス・ポンド	株	イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
BP PLC	7,300	5.463	39,879.900	
UNILEVER PLC	500	42.830	21,415.000	

	PRUDENTIAL PLC	1,000	17.105	17,105.000	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	3,700	15.532	57,468.400	
	BEAZLEY PLC	8,000	5.840	46,720.000	
	DIAGEO PLC	2,400	26.855	64,452.000	
	RIO TINTO PLC	200	35.645	7,129.000	
	ASTRAZENECA PLC	1,200	57.010	68,412.000	
	ASHTREAD GROUP PLC	2,700	23.610	63,747.000	
	BHP BILLITON PLC	2,300	16.184	37,223.200	
	HSBC HOLDINGS PLC	4,800	6.701	32,164.800	
	ANGLO AMERICAN PLC	400	15.300	6,120.000	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	700	46.620	32,634.000	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,000	25.070	75,210.000	
イギリス・ポンド 小計				イギリス・ポンド 569,680.300 (81,891,543)	
オーストラリア・ドル		株	オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	4,000	19.110	76,440.000	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	1,000	30.890	30,890.000	
	CSL LTD	200	227.440	45,488.000	
	COMPUTERSHARE LTD	4,000	18.980	75,920.000	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	500	53.450	26,725.000	
オーストラリア・ドル 小計				オーストラリア・ドル 255,463.000 (20,449,813)	
カナダ・ドル		株	カナダ・ドル	カナダ・ドル	
	SUNCOR ENERGY INC	2,200	52.730	116,006.000	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	200	123.230	24,646.000	
	TORONTO-DOMINION BANK	600	79.390	47,634.000	
	ROYAL BANK OF CANADA	600	103.760	62,256.000	
	SHOPIFY INC - CLASS A	100	184.390	18,439.000	
カナダ・ドル 小計				カナダ・ドル 268,981.000 (22,712,756)	
シンガポール・ドル		株	シンガポール・ドル	シンガポール・ドル	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	1,500	24.490	36,735.000	
シンガポール・ドル 小計				シンガポール・ドル 36,735.000	

				(2,972,596)	
スイス・フラン		株	スイス・フラン	スイス・フラン	
	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	50	237.700	11,885.000	
	NESTLE SA-REG	700	79.900	55,930.000	
	FISCHER (GEORG)-REG	15	1,210.000	18,150.000	
	NOVARTIS AG-REG	900	79.460	71,514.000	
スイス・フラン	小計			スイス・フラン 157,479.000 (18,064,416)	
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	400	306.500	122,600.000	
	DSV A/S	800	600.400	480,320.000	
デンマーク・クローネ	小計			デンマーク・クローネ 602,920.000 (10,472,720)	
ノルウェー・ク ローネ		株	ノルウェー・クローネ	ノルウェー・クローネ	
	EQUINOR ASA	3,500	210.100	735,350.000	
ノルウェー・クローネ	小計			ノルウェー・クローネ 735,350.000 (9,743,388)	
ユーロ		株	ユーロ	ユーロ	
	SIEMENS AG-REG	100	108.620	10,862.000	
	ALLIANZ SE-REG	50	180.840	9,042.000	
	SAP SE	700	99.220	69,454.000	
	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	50	184.800	9,240.000	
	AROUNDTOWN SA	6,000	7.620	45,720.000	
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	400	20.860	8,344.000	
	DEUTSCHE BOERSE AG	200	117.500	23,500.000	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	1,100	43.280	47,608.000	
	VONOVIA SE	1,300	43.480	56,524.000	
	UNILEVER NV-CVA	600	48.190	28,914.000	
	WOLTERS KLUWER	700	53.700	37,590.000	
	ASML HOLDING NV	250	167.320	41,830.000	
	TOTAL SA	600	52.530	31,518.000	
	AIR LIQUIDE SA	100	105.600	10,560.000	
	KERING	60	439.200	26,352.000	
	THALES SA	200	117.300	23,460.000	



	L'OREAL	300	199.450	59,835.000	
	PERNOD RICARD SA	100	134.700	13,470.000	
	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	200	281.250	56,250.000	
	ACCOR SA	200	43.530	8,706.000	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	400	87.840	35,136.000	
	SANOFI	400	72.550	29,020.000	
	VINCI SA	600	79.460	47,676.000	
	AIRBUS SE	750	103.000	77,250.000	
	SAFRAN SA	300	109.100	32,730.000	
	ARKEMA	200	104.250	20,850.000	
	AMADEUS IT GROUP SA	400	76.940	30,776.000	
ユーロ 小計				ユーロ 892,217.000 (115,515,335)	
香港・ドル		株	香港・ドル	香港・ドル	
	TENCENT HOLDINGS LTD	1,600	324.800	519,680.000	
	AIA GROUP LTD	9,000	65.800	592,200.000	
	PING AN INSURANCE GROUP CO- H	12,000	76.000	912,000.000	
	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	3,000	73.000	219,000.000	
香港・ドル 小計				香港・ドル 2,242,880.000 (31,804,038)	
合計				1,507,952,449 [1,507,952,449]	

## (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 133銘柄	100%	79.2%
イギリス・ポンド	株式 14銘柄	100%	5.4%
オーストラリア・ドル	株式 5銘柄	100%	1.4%
カナダ・ドル	株式 5銘柄	100%	1.5%
シンガポール・ドル	株式 1銘柄	100%	0.2%

スイス・フラン	株式	4銘柄	100%	1.2%
デンマーク・クローネ	株式	2銘柄	100%	0.7%
ノルウェー・クローネ	株式	1銘柄	100%	0.6%
ユーロ	株式	27銘柄	100%	7.7%
香港・ドル	株式	4銘柄	100%	2.1%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

## 「ダイワ日本ハーモニース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

	平成30年3月6日現在	平成30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	34,008,922	55,995,012
株式	1,495,229,840	1,434,317,010
未収入金	-	25,949,686
未収配当金	1,372,000	541,200
流動資産合計	1,530,610,762	1,516,802,908
資産合計	1,530,610,762	1,516,802,908
負債の部		
流動負債		
未払金	-	26,811,389
その他未払費用	-	217
流動負債合計	-	26,811,606
負債合計	-	26,811,606
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,160,699,335
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		369,911,427
元本等合計		1,489,991,302

純資産合計	1,530,610,762	1,489,991,302
負債純資産合計	1,530,610,762	1,516,802,908

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成30年3月7日 至 平成30年9月6日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式  移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、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。

## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年3月6日現在	平成30年9月6日現在
1. 1 期首	平成29年9月7日	平成30年3月7日
期首元本額	1,387,534,616円	1,160,699,335円
期中追加設定元本額	14,684,877円	24,215,060円
期中一部解約元本額	241,520,158円	28,753,307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）	283,475,372円	282,347,290円
6 資産バランスファンド（成長型）	785,628,575円	788,129,482円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	91,595,388円	85,684,316円

計	1,160,699,335円	1,156,161,088円
2. 期末日における受益権の総数	1,160,699,335口	1,156,161,088口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年3月7日 至 平成30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	平成30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	平成30年3月6日現在	平成30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	90,948,034	64,135,075
合計	90,948,034	64,135,075

（注） 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年9月7日から平成30年3月6日まで、及び平成30年3月7日から平成30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

平成30年3月6日現在	平成30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）

	平成30年3月6日現在	平成30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）	1.3187円 (13,187円)	1.2887円 (12,887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	
双日	79,500	383.00	30,448,500	
ニチレイ	3,000	2,701.00	8,103,000	
グ ン ゼ	4,500	5,590.00	25,155,000	
日清紡ホールディングス	10,000	1,233.00	12,330,000	
野村不動産HLDGS	9,000	2,275.00	20,475,000	
カネカ	56,000	990.00	55,440,000	
三井化学	23,000	2,744.00	63,112,000	
J S R	19,000	2,066.00	39,254,000	
日本新薬	2,300	6,740.00	15,502,000	
大塚ホールディングス	9,100	5,211.00	47,420,100	
オリエンタルランド	4,600	11,685.00	53,751,000	
リゾートトラスト	12,300	1,777.00	21,857,100	
大塚商会	5,700	3,980.00	22,686,000	
ポーラ・オルビスHD	4,000	3,705.00	14,820,000	

J X T Gホールディングス	28,000	736.60	20,624,800	
東海カーボン	16,000	1,994.00	31,904,000	
フジクラ	50,000	612.00	30,600,000	
リクルートホールディングス	8,400	3,410.00	28,644,000	
ディスコ	1,800	18,520.00	33,336,000	
ダイキン工業	2,600	13,835.00	35,971,000	
ダイフク	3,000	5,500.00	16,500,000	
日本電産	2,300	15,825.00	36,397,500	
I D E C	5,000	2,302.00	11,510,000	
セイコーエプソン	20,400	1,833.00	37,393,200	
ソ ニ ー	8,400	6,288.00	52,819,200	
アドバンテスト	17,000	2,635.00	44,795,000	
エスベック	7,000	2,188.00	15,316,000	
カ シ オ	20,200	1,786.00	36,077,200	
ロ ー ム	4,300	9,790.00	42,097,000	
村田製作所	1,600	18,665.00	29,864,000	
ティラド	6,400	2,904.00	18,585,600	
アイシン精機	2,700	5,010.00	13,527,000	
バンダイナムコH L D G S	5,500	4,290.00	23,595,000	
ヤマハ	8,700	5,380.00	46,806,000	
ビジョン	11,800	5,560.00	65,608,000	
阪和興業	16,500	3,630.00	59,895,000	
上新電機	8,700	2,856.00	24,847,200	
テクノアソシエ	13,500	1,290.00	17,415,000	
丸井グループ	4,100	2,435.00	9,983,500	
三菱U F JフィナンシャルG	91,700	670.30	61,466,510	
りそなホールディングス	46,000	603.60	27,765,600	
東京海上H D	11,000	5,095.00	56,045,000	
S C S K	6,500	5,210.00	33,865,000	
コナミホールディングス	9,200	4,425.00	40,710,000	
合計			1,434,317,010	

## (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

	平成30年3月6日現在	平成30年9月6日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金	2,179,297,768	4,631,432,899
コール・ローン	722,379,021	348,711,435
投資証券	94,780,092,465	95,558,076,954
派生商品評価勘定	139,586	817,531
未収入金	1,169,282,292	1,461,508,764
未収配当金	41,734,871	55,873,309
流動資産合計	98,892,926,003	102,056,420,892
資産合計	98,892,926,003	102,056,420,892
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	354,609	666,953
未払金	212,145,878	646,756,755
未払解約金	150,000,000	145,632,000
その他未払費用	-	2,186
流動負債合計	362,500,487	793,057,894
負債合計	362,500,487	793,057,894
純資産の部		
元本等		
元本	1 48,287,349,682	43,223,443,814
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	50,243,075,834	58,039,919,184
元本等合計	98,530,425,516	101,263,362,998
純資産合計	98,530,425,516	101,263,362,998
負債純資産合計	98,892,926,003	102,056,420,892

## 注記表

## （重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成30年3月7日 至 平成30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られた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>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、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>



## （貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年3月6日現在	平成30年9月6日現在
1. 1 期首	平成29年9月7日	平成30年3月7日
期首元本額	52,438,104,238円	48,287,349,682円
期中追加設定元本額	231,363,950円	70,855,445円
期中一部解約元本額	4,382,118,506円	5,134,761,313円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワ・グローバルREIT・オープン（毎月分配型）	43,659,355,110円	39,025,547,124円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	39,191,006円	35,755,499円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	22,300,301円	18,805,156円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	19,940,781円	17,749,185円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	107,509,700円	91,629,916円
6資産バランスファンド（分配型）	182,352,972円	159,190,220円
6資産バランスファンド（成長型）	396,222,024円	355,878,038円
りそな ワールド・リート・ファンド	1,879,830,660円	1,690,804,511円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	57,412,853円	48,068,749円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	5,211,062円	4,488,050円
常陽3分法ファンド	274,149,067円	232,845,155円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	65,861,047円	55,595,836円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/安定コース）	225,996,300円	220,558,950円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/6分散コース）	302,132,092円	298,594,095円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽/成長コース）	377,173,205円	378,648,758円

ダイワ・グローバルREIT ファンド(ダイワSMA専 用)	53,795,100円	50,327,337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)	549,334,706円	476,802,601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)	29,890,187円	26,778,531円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(為替ヘッジなし)	39,691,509円	35,376,103円
計	48,287,349,682円	43,223,443,814円
2. 期末日における受益権の総数	48,287,349,682口	43,223,443,814口

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年3月7日 至 平成30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	平成30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	平成30年3月6日現在	平成30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	3,702,025,374	6,288,985,794
合計	3,702,025,374	6,288,985,794

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年9月16日から平成30年3月6日まで、及び平成30年3月16日から平成30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	平成30年3月6日 現在				平成30年9月6日 現在			
	契約額等		時価	評価損益	契約額等		時価	評価損益
	(円)	うち 1年超	(円)	(円)	(円)	うち 1年超	(円)	(円)

市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	246,418,110	-	246,475,783	57,673	819,324,720	-	818,674,369	650,351
アメリカ・ドル	60,605,443	-	60,598,892	6,551	426,370,144	-	425,719,793	650,351
イギリス・ポンド	175,649,179	-	175,637,243	11,936	-	-	-	-
シンガポール・ドル	10,163,488	-	10,239,648	76,160	-	-	-	-
ユーロ	-	-	-	-	392,954,576	-	392,954,576	0
買 建	246,418,110	-	246,260,760	157,350	652,074,720	-	651,574,947	499,773
アメリカ・ドル	185,812,667	-	185,569,688	242,979	392,954,576	-	392,422,675	531,901
イギリス・ポンド	-	-	-	-	150,995,986	-	151,163,166	167,180
シンガポール・ドル	8,993,953	-	9,006,014	12,061	108,124,158	-	107,989,106	135,052
ユーロ	51,611,490	-	51,685,058	73,568	-	-	-	-
合計	492,836,220	-	492,736,543	215,023	1,471,399,440	-	1,470,249,316	150,578

## (注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

## （1口当たり情報）

	平成30年3月6日現在	平成30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）	2,0405円 (20,405円)	2,3428円 (23,428円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	164,671	6,338,186.790	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	112,514	20,523,678.740	
		BOSTON PROPERTIES INC	118,394	15,515,533.700	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	268,099	11,721,288.280	
		VORNADO REALTY TRUST	56,536	4,322,742.560	
		EQUITY RESIDENTIAL	130,264	8,783,701.520	
		EPR PROPERTIES	125,754	8,815,355.400	
		EQUINIX INC	10,349	4,452,243.290	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	288,006	7,715,680.740	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	164,619	3,496,507.560	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	256,862	8,484,151.860	
		RLJ LODGING TRUST	338,620	7,503,819.200	
		CYRUSONE INC	109,003	7,207,278.360	
		HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	401,411	11,327,818.420	
		PARK HOTELS & RESORTS INC	203,378	6,841,635.920	
		INVITATION HOMES INC	411,570	9,564,886.800	
		VICI PROPERTIES INC	456,133	9,533,179.700	
		RETAIL VALUE INC	16,132	558,812.480	
		LIFE STORAGE INC	69,949	6,840,312.710	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	381,255	6,927,403.350			
CROWN CASTLE INTL CORP	159,028	18,113,289.200			
IRON MOUNTAIN INC	63,426	2,317,586.040			
VEREIT INC	852,555	6,666,980.100			
SUN COMMUNITIES INC	171,068	17,260,761.200			
PROLOGIS INC	238,220	16,017,912.800			

	COUSINS PROPERTIES INC	376,860	3,493,492.200	
	DDR CORP	442,920	6,174,304.800	
	DUKE REALTY CORP	369,171	10,465,997.850	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	94,674	23,211,224.580	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	56,752	7,385,137.760	
	WELLTOWER INC	212,026	14,262,989.020	
	HCP INC	416,371	11,092,123.440	
	KILROY REALTY CORP	178,159	12,814,976.870	
	REGENCY CENTERS CORP	239,135	15,754,213.800	
	UDR INC	650,299	25,998,954.020	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	227,997	7,482,861.540	
	CUBESMART	301,985	9,177,324.150	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	519,033	8,662,660.770	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	179,494	22,160,329.240	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	145,085	13,402,952.300	
	DOUGLAS EMMETT INC	174,170	6,728,187.100	
アメリカ・ドル	小計		アメリカ・ドル 425,118,476.160 (47,298,681,658)	
イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	17,943,844	9,869,114.200	
	SEGREO PLC	2,412,457	15,729,219.640	
	UNITE GROUP PLC	822,252	7,157,703.660	
	WORKSPACE GROUP PLC	278,914	2,964,855.820	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	1,146,458	6,076,227.400	
	BIG YELLOW GROUP PLC	566,212	5,407,324.600	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	4,503,722	8,165,247.980	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	3,382,503	5,100,814.520	
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 60,470,507.820 (8,692,635,500)	
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル	
	NATIONAL STORAGE REIT	1,668,120	1,234,408.800	
	NATIONAL STORAGE REIT	12,652,580	21,382,860.200	
	DEXUS	2,408,986	26,065,228.520	
	GPT GROUP	6,855,156	35,578,259.640	
	GOODMAN GROUP	3,394,857	35,883,638.490	
	CHARTER HALL GROUP	3,072,743	22,093,022.170	

	INGENIA COMMUNITIES GROUP	7,063,987	21,403,880.610	
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 163,641,298.430 (13,099,485,940)	
カナダ・ドル	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	317,793	15,730,753.500	カナダ・ドル
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	403,368	17,723,989.920	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 33,454,743.420 (2,824,918,534)	
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	14,938,013	20,465,077.810	シンガポール・ドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	771,800	2,114,732.000	
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	5,990,300	16,173,810.000	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	3,027,100	6,084,471.000	
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 44,838,090.810 (3,628,298,309)	
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	607,861	7,865,721.340	ユーロ
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	32,149	5,637,005.660	
	GECINA SA	147,249	21,822,301.800	
	KLEPIERRE	646,728	19,589,391.120	
	COVIVIO	237,822	21,320,742.300	
	AEDIFICA	62,403	5,035,922.100	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	22,397	2,750,351.600	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	1,573,783	14,825,035.860	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	1,622,882	19,150,007.600	
ユーロ 小計			ユーロ 117,996,479.380 (15,277,004,185)	
香港・ドル	FORTUNE REIT	13,505,070	127,487,860.800	香港・ドル
	LINK REIT	2,719,920	206,577,924.000	
香港・ドル 小計			香港・ドル 334,065,784.800 (4,737,052,828)	
投資証券 合計			95,558,076.954 [95,558,076,954]	
合計			95,558,076.954	

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 41銘柄	100%	49.4%
イギリス・ポンド	投資証券 8銘柄	100%	9.1%
オーストラリア・ドル	投資証券 7銘柄	100%	13.7%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	100%	3.0%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	3.8%
ユーロ	投資証券 9銘柄	100%	16.0%
香港・ドル	投資証券 2銘柄	100%	5.0%

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

## 貸借対照表

	平成30年3月6日現在	平成30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	517,892,637	479,336,768
投資証券	93,684,135,940	101,219,095,550
未収入金	933,727,382	608,378,213
未収配当金	1,198,820,859	1,179,131,688
流動資産合計	96,334,576,818	103,485,942,219
資産合計	96,334,576,818	103,485,942,219



負債の部		
流動負債		
未払金	698,994,727	517,495,801
未払解約金	12,123,000	159,985,000
その他未払費用	-	4,047
流動負債合計	711,117,727	677,484,848
負債合計	711,117,727	677,484,848
純資産の部		
元本等		
元本	1 40,836,380,355	40,889,807,890
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	54,787,078,736	61,918,649,481
元本等合計	95,623,459,091	102,808,457,371
純資産合計	95,623,459,091	102,808,457,371
負債純資産合計	96,334,576,818	103,485,942,219

## 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年3月7日 至 平成30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、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年3月6日現在	平成30年9月6日現在
1. 1 期首	平成29年9月7日	平成30年3月7日
期首元本額	37,276,224,895円	40,836,380,355円
期中追加設定元本額	4,242,247,612円	1,643,461,090円
期中一部解約元本額	682,092,152円	1,590,033,555円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	20,325,019円	17,894,919円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	18,948,713円	16,490,542円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	98,716,224円	85,311,322円
6資産バランスファンド(分配型)	163,806,078円	147,502,555円
6資産バランスファンド(成長型)	361,286,590円	334,761,471円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	53,513,113円	44,925,497円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	2,335,572円	2,007,628円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	58,067,894円	51,983,532円
成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-07	25,789,522円	21,566,146円
成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-08	31,902,327円	24,240,369円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	199,233,766円	206,431,289円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	268,900,064円	279,761,813円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	334,191,272円	354,438,518円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	361,890,370円	359,264,261円
ダイワファンドラップJ-REITセレクト	37,787,745,778円	37,911,619,930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）	127,017,669円	117,344,235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）	41,991,066円	38,745,084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）	201,749,453円	183,539,602円
ダイワ・アクティブリート・ファンド（年4回決算型）	678,969,865円	691,979,177円
計	40,836,380,355円	40,889,807,890円
2. 期末日における受益権の総数	40,836,380,355口	40,889,807,890口

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年3月7日 至 平成30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	平成30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	平成30年3月6日現在	平成30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	2,531,144,694	809,025,157
合計	2,531,144,694	809,025,157

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間(平成29年11月11日から平成30年3月6日まで、及び平成30年5月11日から平成30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

平成30年3月6日現在	平成30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)

	平成30年3月6日現在	平成30年9月6日現在
1口当たり純資産額	2.3416円	2.5143円
(1万口当たり純資産額)	(23,416円)	(25,143円)

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	券面総額	評価額 (円)	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	3,179	1,627,648,000	

MCUBS MidCity投資法人	19,205	1,630,504,500	
森ヒルズリート	22,201	3,183,623,400	
産業ファンド	7,539	869,246,700	
アドバンス・レジデンス	8,480	2,425,280,000	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	10,714	1,823,522,800	
API投資法人	5,240	2,541,400,000	
GLP投資法人	14,491	1,565,028,000	
コンフォリア・レジデンシャル	3,439	899,298,500	
日本プロロジスリート	20,899	4,474,475,900	
星野リゾート・リート	3,773	2,112,880,000	
イオンリート投資	8,554	1,016,215,200	
ヒューリックリート投資法	14,341	2,344,753,500	
日本リート投資法人	6,323	2,282,603,000	
インベスコ・オフィス・Jリート	89,507	1,418,685,950	
日本ヘルスケア投資法	432	77,198,400	
積水ハウス・リート投資	40,163	2,931,899,000	
ケネディクス商業リート	7,564	1,820,654,800	
ヘルスケア&メディカル投資	1,801	206,934,900	
野村不動産マスターF	37,517	5,713,839,100	
ラサールロジポート投資	11,402	1,158,443,200	
三井不動産パーク	4,708	1,471,250,000	
大江戸温泉リート	9,864	844,358,400	
投資法人みらい	4,153	789,900,600	
森トラスト・ホテルリート投	1,763	246,820,000	
三菱地所物流REIT	2,329	577,359,100	
CREロジスティクスファンド	4,613	497,742,700	
ザイマックス・リート	8,858	981,466,400	
日本ビルファンド	6,993	4,531,464,000	
ジャパンリアルエステイト	16,489	9,679,043,000	
日本リテールファンド	23,606	4,801,460,400	
オリックス不動産投資	28,644	4,972,598,400	
日本プライムリアルティ	5,675	2,281,350,000	
プレミアム投資法人	15,023	1,709,617,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	4,515	518,322,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	16,960	2,969,696,000	
森トラスト総合リート	7,939	1,298,026,500	
インヴィンシブル投資法人	39,262	1,857,092,600	
フロンティア不動産投資	4,551	2,041,123,500	
平和不動産リート	1,165	127,917,000	

日本ロジスティクスファンド投資法人	751	160,038,100	
福岡リート投資法人	5,527	950,644,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	4,633	3,210,669,000	
いちごオフィスリート投資法人	4,358	402,243,400	
大和証券オフィス投資法人	2,580	1,780,200,000	
阪急阪神リート投資法人	1,068	150,481,200	
スタートプロシード投資法人	4,455	765,369,000	
大和ハウスリート投資法人	19,420	4,979,288,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	25,998	2,163,033,600	
日本賃貸住宅投資法人	18,497	1,672,128,800	
ジャパンエクセレント投資法人	4,528	664,257,600	
投資証券 合計		101,219,095,550	
合計		101,219,095,550	

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】

2018年9月28日

資産総額	691,092,481円
負債総額	586,577円
純資産総額（ - ）	690,505,904円
発行済数量	701,001,355口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.9850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

2018年9月28日

資産総額	29,828,316,349円
負債総額	58,016,414円
純資産総額（ - ）	29,770,299,935円
発行済数量	17,667,901,659口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.6850円

## (参考) ダイワ日本国債マザーファンド

## 純資産額計算書

2018年9月28日

資産総額	259,865,762,311円
負債総額	140,890,031円
純資産総額（ - ）	259,724,872,280円
発行済数量	207,962,269,075口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.2489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

2018年9月28日

資産総額	1,610,690,688円
負債総額	29,093,803円
純資産総額（ - ）	1,581,596,885円
発行済数量	683,071,930口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.3154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

2018年9月28日

資産総額	1,601,755,300円
負債総額	106円
純資産総額（ - ）	1,601,755,194円
発行済数量	1,175,115,783口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3631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

2018年9月28日

資産総額	100,327,572,345円
負債総額	273,495,843円
純資産総額（ - ）	100,054,076,502円
発行済数量	42,703,437,651口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.3430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

2018年9月28日

資産総額	105,415,068,055円
負債総額	275,493,956円
純資産総額（ - ）	105,139,574,099円
発行済数量	41,078,505,416口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.5595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。

## 第二部 【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

2018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。

2018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	81	177,728
追加型株式投資信託	712	16,079,881
株式投資信託 合計	793	16,257,609
単位型公社債投資信託	28	107,888
追加型公社債投資信託	14	1,484,253
公社債投資信託 合計	42	1,592,142
総合計	835	17,849,750

## 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(平成29年4月1日から平成30年3月31日まで)の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。
3. 財務諸表の記載金額は、百万円未満を切り捨てて表示しております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,260	28,709
有価証券	110	0
前払費用	190	201
未収委託者報酬	10,453	12,368
未収収益	72	82
繰延税金資産	439	552
その他	34	47
流動資産計	42,560	41,962
固定資産		
有形固定資産	1	213
建物	15	12
器具備品	214	200
無形固定資産	2,650	2,614
ソフトウェア	2,323	2,456
ソフトウェア仮勘定	327	158
投資その他の資産	12,353	15,066
投資有価証券	5,920	8,600
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	185	183
長期差入保証金	1,050	1,072
繰延税金資産	31	45
その他	37	34
固定資産計	15,234	17,894
資産合計	57,795	59,856

（単位:百万円）

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	79	65
未払金	9,466	9,747
未払収益分配金	7	8
未払償還金	59	59
未払手数料	4,453	5,202
その他未払金	2 4,946	2 4,476
未払費用	4,077	4,148
未払法人税等	980	850
未払消費税等	223	583
賞与引当金	945	1,012
その他	3	335
流動負債計	15,776	16,744
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	2,318	2,350
役員退職慰労引当金	151	125
その他	7	5
固定負債計	2,477	2,481
負債合計	18,254	19,225
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	15,174	15,174
<b>資本剰余金</b>		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	374	374
<b>その他利益剰余金</b>		
繰越利益剰余金	12,231	13,370
利益剰余金合計	12,606	13,744
株主資本合計	39,276	40,414
評価・換算差額等		

その他有価証券評価差額金	264	216
評価・換算差額等合計	264	216
純資産合計	39,540	40,631
負債・純資産合計	57,795	59,856

## (2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	当事業年度 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	79,747	82,510
その他営業収益	727	733
営業収益計	80,474	83,244
営業費用		
支払手数料	40,110	40,392
広告宣伝費	549	673
調査費	9,436	9,816
調査費	904	955
委託調査費	8,531	8,860
委託計算費	793	839
営業雑経費	1,375	1,579
通信費	251	249
印刷費	501	500
協会費	50	53
諸会費	13	13
その他営業雑経費	557	762
営業費用計	52,265	53,300
一般管理費		
給料	5,833	5,840
役員報酬	416	377
給料・手当	3,940	3,973
賞与	531	477
賞与引当金繰入額	945	1,012
福利厚生費	807	788
交際費	60	55
旅費交通費	178	195
租税公課	531	501
不動産賃借料	1,273	1,281
退職給付費用	463	316



役員退職慰労引当金繰入額	60	46
固定資産減価償却費	1,045	977
諸経費	1,400	1,528
一般管理費計	11,655	11,531
営業利益	16,554	18,411

(単位:百万円)

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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

(単位：百万円)

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価 証券評価 差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	264	264	39,540
当期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
当期純利益	-	-	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	47	47	47
当期変動額合計	47	47	1,090
当期末残高	216	216	40,631

## 注記事項

(重要な会計方針)

## 1．有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

## (2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

## 2．固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
----	--------

器具備品 4～20年

(2) 無形固定資産

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4. 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5. 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(損益計算書)

前事業年度において、「営業外収益」に独立掲記しておりました「受取利息」は、金額的重要性が乏しいため、当事業年度より「営業外収益」の「その他」としております。この表示方法の変更を反映させるため、前事業年度の財務諸表の組替えを行っております。

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」に表示していた「受取利息」12百万円、「その他」56百万円は、「その他」69百万円として組替えております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社項目

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

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

### 3 保証債務

前事業年度(平成29年3月31日)

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

当事業年度(平成30年3月31日)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,701百万円に対して保証を行っております。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

#### 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

#### 2. 配当に関する事項

##### (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額(百万円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成28年6月23日 定時株主総会	普通株式	13,261	5,084	平成28年 3月31日	平成28年 6月24日

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

平成29年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

## 1．発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

## 2．配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	剰余金の配当の 総額（百万円）	1株当たり 配当額（円）	基準日	効力発生日
平成29年6月26日 定時株主総会	普通株式	11,532	4,421	平成29年 3月31日	平成29年 6月27日

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

平成30年6月25日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

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

## (金融商品関係)

## 1．金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 市場リスクの管理

## ( ) 為替変動リスクの管理

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

## ( ) 価格変動リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	31,260	31,260	-
(2) 未収委託者報酬	10,453	10,453	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	5,060	5,060	-
資産計	46,774	46,774	-
(1) 未払手数料	(4,453)	(4,453)	-
(2) その他未払金	(4,946)	(4,946)	-
(3) 未払費用(*2)	(3,409)	(3,409)	-
負債計	(12,809)	(12,809)	-

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

(\*1) 負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(\*2) 未払費用のうち金融商品で時価開示の対象となるものを表示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法

#### 資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

#### 負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：百万円)

区分	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
(1) その他有価証券 非上場株式	970	970
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	1,050	1,072

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成29年3月31日)

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	31,260	-	-	-
未収委託者報酬	10,453	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	110	2,876	1,139	110
合計	41,824	2,876	1,139	110

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位：百万円)



	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金・預金	28,709	-	-	-
未収委託者報酬	12,368	-	-	-
有価証券及び投資有価証券 <sub>    </sub> 其他有価証券のうち満期があるもの	0	5,302	1,801	117
合計	41,078	5,302	1,801	117

## (有価証券関係)

## 1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成29年3月31日)

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

当事業年度(平成30年3月31日)

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

## 2. 其他有価証券

前事業年度(平成29年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	122	55	67
(2) その他			
証券投資信託	3,107	2,697	410
小計	3,230	2,752	478
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他			
証券投資信託	1,829	1,926	96
小計	1,829	1,926	96
合計	5,060	4,679	381

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「其他有価証券」には含めておりません。

当事業年度(平成30年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			

(1) 株式	134	55	79
(2) その他 証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの その他 証券投資信託	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

### 3. 売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	50	-	1
(2) その他 証券投資信託	4,371	224	23
合計	4,421	224	24

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

種類	売却額 (百万円)	売却益の合計額 (百万円)	売却損の合計額 (百万円)
(1) 株式	-	-	-
(2) その他 証券投資信託	1,963	210	0
合計	1,963	210	0

### 4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

#### 1. 採用している退職給付制度の概要

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

#### 2. 確定給付制度

## (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

## (3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

前事業年度（平成29年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

当事業年度（平成30年3月31日）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

## 1. サービスごとの情報

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

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 営業収益

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## [報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

## (関連当事者情報)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有) 直接100.0	経営管理	債務保証 (注)	1,685	-	-

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合 (%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	-------------------	-------	-----------------------	-----------	-------	---------------	----	---------------

子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,701	-	-
-----	---	-----------	-----	---------	-------------	------	---------	-------	---	---

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

## 前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,238	未払手数料	3,298
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	768	未払費用	218
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,036	長期差入保証金	1,028

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券㈱	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	23,216	未払手数料	3,913
同一の親会社をもつ会社	㈱大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	1,020	未払費用	233
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ㈱	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,048	長期差入保証金	1,055

## 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

## 2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

## （1株当たり情報）

前事業年度 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）		当事業年度 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）	
1株当たり純資産額	15,158.25円	1株当たり純資産額	15,576.40円
1株当たり当期純利益	4,421.51円	1株当たり当期純利益	4,857.40円

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）	当事業年度 （自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）
当期純利益（百万円）	11,533	12,670
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

#### 4 【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5 【その他】

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

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

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

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



## 第2 【その他の関係法人の概況】

## 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（2018年3月末日現在）

事業の内容

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

## (2) 販売会社

名 称	資本金の額 単位：百万円 (2018年3月 末日現在)	事業の内容
株式会社関西アーバン銀行	47,039	(注)

(注) 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 511千米ドル（約57百万円）（2017年12月末日現在）

事業の内容 資産運用業務を行なっています。

## 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。

## &lt;再信託受託会社の概要&gt;

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2018年3月末日現在）

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

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

## 第3 【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が関東財務局長に提出されております。

（提出年月日）	（書類名）
2018年3月16日	臨時報告書
2018年5月30日	有価証券届出書、有価証券報告書
2018年6月18日	臨時報告書

**独立監査人の監査報告書**

平成30年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社  
取締役会 御中

## 有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第59期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年10月5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）の平成30年3月7日から平成30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）の平成30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。