

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長殿

【提出日】 平成30年4月6日提出

【発行者名】 大和証券投資信託委託株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 岩本 信之

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【事務連絡者氏名】 高橋 慎
連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

【電話番号】 03-5555-3431

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 『しがぎん』S R I 三資産バランス・オープン
（奇数月分配型）（愛称：OHみらい）

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 5,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

．【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2017年10月11日付で提出した有価証券届出書（以下「原有価証券届出書」）の記載事項を、有価証券報告書の提出に伴い新たな内容に改めるため、本訂正届出書を提出致します。

．【訂正の内容】

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

第一部 【証券情報】

< 更新後 >

< 略 >

(12) 【その他】

< 略 >

ニューヨーク証券取引所またはICEフューチャーズ・ヨーロッパのいずれかの休業日と同じ日付の日を申込受付日とする受益権の取得および換金の申込みの受付けは、行ないません。

申込受付中止日は、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

< 略 >

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

<略>

<ファンドの特色>

<略>

3<略>

<略>

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 AA- }
	A { A1 A2 A3 }	A { A+ A A- }
	Baa	BBB
	Ba	BB
	B	B
	Caa	CCC
	Ca	CC
	C	C
低い		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。

<略>

(3) 【ファンドの仕組み】

<更新後>

<略>

<委託会社の概況(2018年1月末日現在)>

<略>

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

<更新後>

< 略 >

上記の運用体制は2018年1月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

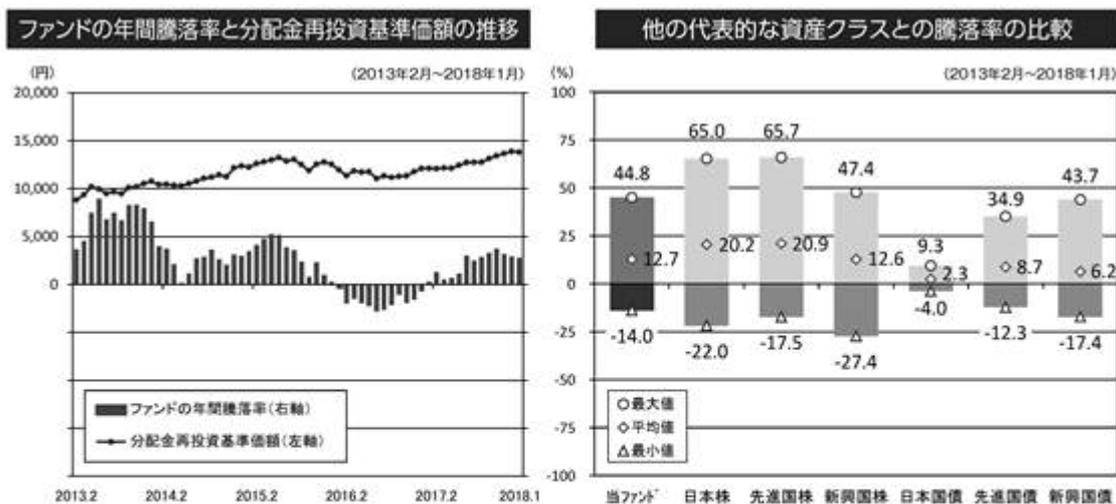
3 【投資リスク】

< 更新後 >

< 略 >

参 考 情 報

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



- ※各資産クラスは、ファンドの投資対象を表しているものではありません。
- ※ファンドの年間騰落率は、分配金（税引前）を分配時にファンドへ再投資したものとみなして計算したものであり、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。
- ※ファンドの年間騰落率において、過去5年間分のデータが算出できない場合は以下のルールで表示しています。
- ①年間騰落率に該当するデータがない場合には表示されません。
 - ②年間騰落率が算出できない期間がある場合には、算出可能な期間についてのみ表示しています。
 - ③インデックスファンドにおいて、①②に該当する場合には、当該期間についてベンチマークの年間騰落率で代替して表示します。

※資産クラスについて

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

※指数について

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

4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

<更新後>

<略>

() 上記は、2018年1月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

<略>

5 【運用状況】

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

<訂正後>

(1) 【投資状況】（平成30年1月31日現在）

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	52,457,870	44.59
内 日本	52,457,870	44.59
親投資信託受益証券	64,038,071	54.43
内 日本	64,038,071	54.43
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,151,926	0.98
純資産総額	117,647,867	100.00

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

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

(2) 【投資資産】（平成30年1月31日現在）

【投資有価証券の主要銘柄】

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワSRIファンド	日本	投資信託 受益証券	39,356,194	1.3628 53,634,622	1.3329 52,457,870	44.59
2	ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	27,620,761	1.7145 47,355,795	1.6940 46,789,569	39.77
3	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	5,211,062	2.2080 11,506,024	2.1775 11,347,087	9.64
4	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	日本	親投資信 託受益証 券	2,421,491	2.3839 5,772,834	2.4371 5,901,415	5.02

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資信託受益証券	44.59%
親投資信託受益証券	54.43%
合計	99.02%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第4特定期間末 (平成20年7月15日)	761,431,836	764,077,239	0.8635	0.8665
第5特定期間末 (平成21年1月15日)	497,985,183	500,567,676	0.5785	0.5815
第6特定期間末 (平成21年7月15日)	527,342,643	529,907,249	0.6169	0.6199
第7特定期間末 (平成22年1月15日)	495,920,918	498,107,255	0.6805	0.6835
第8特定期間末 (平成22年7月15日)	423,499,174	425,518,422	0.6292	0.6322
第9特定期間末 (平成23年1月17日)	375,000,976	376,719,030	0.6548	0.6578
第10特定期間末 (平成23年7月15日)	324,615,470	326,154,768	0.6327	0.6357
第11特定期間末 (平成24年1月16日)	242,704,479	243,992,397	0.5653	0.5683
第12特定期間末 (平成24年7月17日)	220,887,840	222,008,968	0.5911	0.5941
第13特定期間末 (平成25年1月15日)	229,696,095	230,686,324	0.6959	0.6989
第14特定期間末 (平成25年7月16日)	253,074,244	254,009,452	0.8118	0.8148
第15特定期間末 (平成26年1月15日)	229,419,669	230,221,803	0.8580	0.8610
第16特定期間末 (平成26年7月15日)	219,048,037	219,807,672	0.8651	0.8681
第17特定期間末 (平成27年1月15日)	190,367,012	190,965,134	0.9548	0.9578
第18特定期間末 (平成27年7月15日)	160,666,940	161,143,900	1.0106	1.0136
第19特定期間末 (平成28年1月15日)	137,131,073	137,582,463	0.9114	0.9144
第20特定期間末 (平成28年7月15日)	126,011,752	126,443,178	0.8762	0.8792

第21特定期間末 (平成29年1月16日)	130,573,394	130,999,402	0.9195	0.9225
平成29年1月末日	127,867,059	-	0.9194	-
2月末日	127,553,651	-	0.9172	-
3月末日	127,139,372	-	0.9198	-
4月末日	126,320,290	-	0.9178	-
5月末日	123,154,256	-	0.9379	-
6月末日	124,204,143	-	0.9596	-
第22特定期間末 (平成29年7月18日)	124,436,479	124,695,330	0.9615	0.9635
7月末日	124,262,825	-	0.9597	-
8月末日	123,735,897	-	0.9601	-
9月末日	125,081,517	-	0.9863	-
10月末日	126,090,057	-	1.0087	-
11月末日	127,029,650	-	1.0240	-
12月末日	121,640,916	-	1.0397	-
第23特定期間末 (平成30年1月15日)	121,716,054	121,948,212	1.0486	1.0506
平成30年1月末日	117,647,867	-	1.0325	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
第4特定期間	0.0090
第5特定期間	0.0090
第6特定期間	0.0090
第7特定期間	0.0090
第8特定期間	0.0090
第9特定期間	0.0090
第10特定期間	0.0090
第11特定期間	0.0090
第12特定期間	0.0090
第13特定期間	0.0090
第14特定期間	0.0090
第15特定期間	0.0090
第16特定期間	0.0090
第17特定期間	0.0090
第18特定期間	0.0090
第19特定期間	0.0090
第20特定期間	0.0090
第21特定期間	0.0090
第22特定期間	0.0080
第23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4特定期間	3.8
第5特定期間	32.0

第6特定期間	8.2
第7特定期間	11.8
第8特定期間	6.2
第9特定期間	5.5
第10特定期間	2.0
第11特定期間	9.2
第12特定期間	6.2
第13特定期間	19.3
第14特定期間	17.9
第15特定期間	6.8
第16特定期間	1.9
第17特定期間	11.4
第18特定期間	6.8
第19特定期間	8.9
第20特定期間	2.9
第21特定期間	6.0
第22特定期間	5.4
第23特定期間	9.7

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第4特定期間	3,564,151	36,893,577
第5特定期間	2,115,982	23,086,086
第6特定期間	5,367,273	11,329,444
第7特定期間	2,104,783	128,194,456
第8特定期間	1,852,341	57,548,662
第9特定期間	1,778,971	102,176,966
第10特定期間	1,503,436	61,088,931
第11特定期間	1,333,023	85,126,179
第12特定期間	1,126,287	56,723,024
第13特定期間	1,242,757	44,875,647
第14特定期間	1,165,277	19,505,831
第15特定期間	3,870,526	48,228,431
第16特定期間	926,249	15,092,480
第17特定期間	486,410	54,324,323
第18特定期間	332,497	40,719,610
第19特定期間	285,213	8,808,757
第20特定期間	301,849	6,956,240
第21特定期間	350,707	2,156,881
第22特定期間	284,953	12,862,157
第23特定期間	173,743	13,520,271

(参考) 投資信託証券

(F0Fs専用) ダイワSRIファンド(適格機関投資家専用)

(1) 投資状況(平成30年1月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	51,760,695	99.97
内 日本	51,760,695	99.97
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	16,406	0.03
純資産総額	51,777,101	100.00

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

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

(2) 投資資産 (平成30年1月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ダイワSRIマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	22,053,982	2.2766 50,208,106	2.3470 51,760,695	99.97

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ. 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
親投資信託受益証券	99.97%
合計	99.97%

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

ハ. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

参考情報 マザーファンド
ダイワSRIマザーファンド

(1) 投資状況 (平成30年1月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
株式	745,208,150	94.34
内 日本	745,208,150	94.34
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	44,732,968	5.66
純資産総額	789,941,118	100.00

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

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

(2) 投資資産（平成30年1月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	種類	数 業 種 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ソニー	日本	株式	電気機器	6,300	3,937.00 24,803,100	5,209.00 32,816,700	4.15
2	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	38,000	695.04 26,411,899	820.80 31,190,400	3.95
3	ビジョン	日本	株式	その他製 品	6,300	4,458.79 28,090,437	4,260.00 26,838,000	3.40
4	信越化学	日本	株式	化学	1,800	9,846.99 17,724,589	12,410.00 22,338,000	2.83
5	日本電産	日本	株式	電気機器	1,200	10,310.00 12,372,000	17,450.00 20,940,000	2.65
6	JXTGホールディングス	日本	株式	石油・石炭 製品	27,000	651.79 17,598,558	723.80 19,542,600	2.47
7	ローム	日本	株式	電気機器	1,600	8,580.00 13,728,000	11,970.00 19,152,000	2.42
8	三井化学	日本	株式	化学	5,400	3,229.93 17,441,674	3,425.00 18,495,000	2.34
9	ディスコ	日本	株式	機械	700	18,790.00 13,153,000	25,540.00 17,878,000	2.26
10	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	3,600	4,427.92 15,940,543	4,878.00 17,560,800	2.22
11	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機 器	2,300	5,965.00 13,719,500	7,480.00 17,204,000	2.18
12	ダイキン工業	日本	株式	機械	1,200	10,760.00 12,912,000	13,095.00 15,714,000	1.99
13	ダイフク	日本	株式	機械	2,100	3,245.00 6,814,500	7,300.00 15,330,000	1.94
14	ピーエス三菱	日本	株式	建設業	16,000	606.24 9,699,941	949.00 15,184,000	1.92
15	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	1,400	8,577.23 12,008,129	10,660.00 14,924,000	1.89
16	東京海上HD	日本	株式	保険業	2,800	4,828.00 13,518,400	5,140.00 14,392,000	1.82
17	任天堂	日本	株式	その他製 品	300	30,300.00 9,090,000	47,970.00 14,391,000	1.82
18	クレハ	日本	株式	化学	1,800	7,222.65 13,000,770	7,840.00 14,112,000	1.79
19	ウェルビー	日本	株式	サービス業	4,000	3,736.39 14,945,567	3,500.00 14,000,000	1.77
20	豊田自動織機	日本	株式	輸送用機 器	1,900	7,005.27 13,310,024	7,090.00 13,471,000	1.71
21	伊藤忠	日本	株式	卸売業	6,000	1,612.50 9,675,000	2,139.00 12,834,000	1.62

22	大和ハウス	日本	株式	建設業	2,900	3,592.00 10,416,800	4,305.00 12,484,500	1.58
23	日立	日本	株式	電気機器	14,000	815.49 11,416,884	866.40 12,129,600	1.54
24	三菱ケミカルHLDGS	日本	株式	化学	10,000	1,132.47 11,324,790	1,184.50 11,845,000	1.50
25	日本電信電話	日本	株式	情報・通信業	2,200	5,413.40 11,909,494	5,191.00 11,420,200	1.45
26	ニチレイ	日本	株式	食料品	3,900	3,025.00 11,797,500	2,916.00 11,372,400	1.44
27	LIXILグループ	日本	株式	金属製品	3,700	3,103.53 11,483,085	3,065.00 11,340,500	1.44
28	セイコーエプソン	日本	株式	電気機器	3,900	2,839.53 11,074,195	2,647.00 10,323,300	1.31
29	J. フロントリテイリング	日本	株式	小売業	5,100	2,019.44 10,299,165	1,996.00 10,179,600	1.29
30	小松製作所	日本	株式	機械	2,400	3,906.81 9,376,367	4,235.00 10,164,000	1.29

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
株式	94.34%
合計	94.34%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	5.04%
食料品	1.79%
化学	13.18%
医薬品	0.69%
石油・石炭製品	2.96%
ゴム製品	0.25%
非鉄金属	2.06%
金属製品	1.44%
機械	9.27%
電気機器	15.99%
輸送用機器	5.15%
精密機器	1.96%
その他製品	6.40%
海運業	0.49%
情報・通信業	2.67%
卸売業	4.61%
小売業	1.91%
銀行業	6.17%
証券、商品先物取引業	0.54%
保険業	2.60%
その他金融業	1.24%
不動産業	2.62%
サービス業	5.32%

合計	94.34%
----	--------

(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。

(参考) マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資状況 (平成30年1月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
国債証券	30,394,686,178	94.39
内 ユーロ	7,855,457,315	24.40
内 ノルウェー	410,450,436	1.27
内 スウェーデン	689,068,776	2.14
内 デンマーク	933,206,026	2.90
内 イギリス	3,621,816,449	11.25
内 ポーランド	2,328,592,500	7.23
内 カナダ	2,958,661,503	9.19
内 アメリカ	7,654,856,261	23.77
内 オーストラリア	3,942,576,912	12.24
特殊債券	1,000,445,544	3.11
内 カナダ	1,000,445,544	3.11
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	805,550,321	2.50
純資産総額	32,200,682,043	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)	1,832,528,705	5.69
内 日本	1,832,528,705	5.69
為替予約取引(売建)	1,829,951,000	5.68
内 日本	1,829,951,000	5.68

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

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

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

(2) 投資資産 (平成30年1月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ. 主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	45,000,000	94.81 4,641,479,832	92.25 4,516,144,875	1.625000 2026/02/15	14.02
2	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	24,000,000	117.12 2,467,671,552	117.39 2,473,465,692	4.500000 2033/04/21	7.68
3	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	12,800,000	136.02 2,351,887,605	133.34 2,305,618,923	5.400000 2025/03/13	7.16
4	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	9,300,000	128.14 1,834,992,442	125.63 1,799,008,267	5.000000 2025/03/07	5.59
5	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	19,000,000	101.82 1,706,433,624	100.03 1,676,353,014	2.250000 2025/06/01	5.21
6	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	40,000,000	112.35 1,460,550,000	112.23 1,458,990,000	5.750000 2021/10/25	4.53
7	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	10,300,000	103.25 1,436,583,769	101.90 1,417,759,156	0.800000 2025/06/22	4.40
8	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	7,500,000	113.81 1,153,009,110	111.85 1,133,223,267	2.250000 2024/05/25	3.52
9	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債証券	13,500,000	95.58 1,138,142,502	94.09 1,120,401,072	1.500000 2026/06/01	3.48
10	IRISH TREASURY	ユーロ	国債証券	8,000,000	102.65 1,109,276,960	101.47 1,096,579,440	1.000000 2026/05/15	3.41
11	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	5,200,000	133.97 941,059,944	133.66 938,898,394	3.250000 2045/05/25	2.92
12	Poland Government Bond	ポーランド	国債証券	27,000,000	98.16 861,354,000	99.10 869,602,500	2.250000 2022/04/25	2.70
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	8,000,000	99.69 867,665,524	96.90 843,392,299	2.250000 2025/11/15	2.62
14	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,900,000	92.18 792,254,335	90.90 781,283,435	2.500000 2046/02/15	2.43
15	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	8,000,000	112.35 789,070,566	110.94 779,160,831	5.750000 2021/05/15	2.42
16	DANISH GOVERNMENT BOND	デンマーク	国債証券	38,500,000	112.03 782,844,620	109.98 768,561,659	1.750000 2025/11/15	2.39
17	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,200,000	98.61 772,455,126	97.05 760,212,335	1.375000 2021/04/30	2.36
18	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	7,000,000	99.72 759,412,946	98.98 753,823,316	1.500000 2019/10/31	2.34
19	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	4,500,000	102.11 707,491,380	101.08 700,410,299	1.500000 2026/07/22	2.18
20	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	6,800,000	116.48 695,382,834	115.57 689,950,389	4.750000 2027/04/21	2.14
21	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	7,000,000	98.70 609,429,366	97.70 603,212,148	2.250000 2025/12/15	1.87
22	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	3,700,000	103.05 587,092,998	102.07 581,492,956	1.500000 2021/01/22	1.81
23	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	36,000,000	107.34 533,304,864	106.72 530,194,896	1.500000 2023/11/13	1.65

24	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,800,000	109.33 413,534,992	107.36 406,083,979	1.500000 2023/02/15	1.26
25	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	4,500,000	101.32 402,150,987	100.08 397,233,396	2.550000 2025/03/15	1.23
26	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	110.37 311,263,140	108.65 306,404,280	3.000000 2024/03/14	0.95
27	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,500,000	146.27 296,376,326	146.63 297,109,810	3.750000 2045/06/22	0.92
28	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	1,500,000	130.71 264,862,837	128.41 260,184,342	2.500000 2046/08/15	0.81
29	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,500,000	114.62 264,727,549	112.55 259,949,090	4.000000 2022/03/07	0.81
30	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,000,000	150.76 232,125,172	151.53 233,310,741	4.250000 2046/12/07	0.72

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
国債証券	94.39%
特殊債券	3.11%
合計	97.50%

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

ハ．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	カナダ・ドル買/円売 2018年2月	買建	14,621,649	1,296,540,000	1,289,044,575	4.00%
		スウェーデン・クローネ 買/円売 2018年2月	買建	39,382,908	541,920,000	543,484,130	1.69%
		豪ドル売/円買 2018年2月	売建	14,700,000	1,296,540,000	1,289,631,000	4.00%
		ユーロ売/円買 2018年2月	売建	4,000,000	541,920,000	540,320,000	1.68%

(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・グローバルREIT・マザーファンド

(1) 投資状況 (平成30年1月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	102,882,283,371	96.57
内 香港	2,730,304,667	2.56
内 シンガポール	5,173,042,521	4.86
内 イギリス	13,781,990,473	12.94
内 ベルギー	352,918,815	0.33
内 フランス	6,487,063,738	6.09
内 ドイツ	1,810,238,540	1.70
内 スペイン	4,728,367,475	4.44
内 カナダ	2,905,981,386	2.73
内 アメリカ	48,113,970,645	45.16
内 オーストラリア	16,798,405,111	15.77
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	3,655,715,759	3.43
純資産総額	106,537,999,130	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)	893,148,088	0.84
内 日本	893,148,088	0.84
為替予約取引(売建)	894,951,251	0.84
内 日本	894,951,251	0.84

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

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

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

(2) 投資資産（平成30年1月31日現在）

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	DEXUS	オーストラリア	投資証券	4,497,836	825.22 3,711,731,211	821.71 3,695,936,610	3.47
2	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	5,008,951	726.90 3,641,012,493	689.15 3,451,926,095	3.24
3	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	スペイン	投資証券	2,062,745	1,583.27 3,266,184,911	1,549.36 3,195,950,270	3.00
4	LINK REIT	香港	投資証券	2,834,420	890.93 2,525,285,400	963.26 2,730,304,667	2.56
5	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	3,086,132	820.96 2,533,966,336	883.78 2,727,485,811	2.56
6	CROWN CASTLE INTL CORP	アメリカ	投資証券	220,457	11,451.34 2,524,544,905	11,970.16 2,638,906,379	2.48
7	UDR INC	アメリカ	投資証券	675,816	4,237.37 2,863,682,782	3,904.47 2,638,705,393	2.48

8	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	217,576	13,155.97 2,862,424,351	11,592.66 2,522,285,114	2.37
9	GECINA SA	フランス	投資証券	117,389	18,012.91 2,114,518,431	20,910.38 2,454,649,067	2.30
10	UNIBAIL-RODAMCO SE	フランス	投資証券	78,366	28,238.06 2,212,912,731	27,623.86 2,164,771,413	2.03
11	EQUITY RESIDENTIAL	アメリカ	投資証券	322,970	7,319.28 2,363,929,381	6,589.41 2,128,181,845	2.00
12	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	2,011,706	967.39 1,946,360,206	1,034.37 2,080,849,259	1.95
13	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	215,149	9,701.89 2,087,352,405	9,588.75 2,063,010,103	1.94
14	SIMON PROPERTY GROUP INC	アメリカ	投資証券	116,576	17,814.36 2,076,727,123	17,690.34 2,062,269,297	1.94
15	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	150,568	13,876.49 2,089,367,872	12,991.70 1,956,134,557	1.84
16	FORTUNE REIT	シンガポール	投資証券	13,833,070	128.94 1,783,714,894	135.76 1,877,999,716	1.76
17	FONCIERE DES REGIONS	フランス	投資証券	155,876	11,361.84 1,771,047,411	11,981.59 1,867,643,258	1.75
18	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	7,578,273	222.98 1,689,853,330	242.30 1,836,218,579	1.72
19	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	ドイツ	投資証券	1,059,386	1,653.10 1,751,341,789	1,708.76 1,810,238,540	1.70
20	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	カナダ	投資証券	501,527	3,358.65 1,684,456,668	3,597.67 1,804,332,654	1.69
21	KILROY REALTY CORP	アメリカ	投資証券	232,880	7,766.08 1,808,570,328	7,609.86 1,772,184,313	1.66
22	ASSURA PLC	イギリス	投資証券	18,716,147	94.07 1,763,617,675	93.92 1,757,852,344	1.65
23	NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア	投資証券	13,294,696	133.44 1,774,054,870	131.68 1,750,712,043	1.64
24	LAND SECURITIES GROUP PLC	イギリス	投資証券	1,123,749	1,546.47 1,737,997,643	1,532.30 1,721,931,200	1.62
25	PHYSICIANS REALTY TRUST	アメリカ	投資証券	978,661	2,015.76 1,972,851,579	1,735.20 1,698,173,057	1.59
26	HOST HOTELS & RESORTS INC	アメリカ	投資証券	734,106	2,174.71 1,596,525,482	2,266.09 1,663,554,450	1.56
27	KEPPEL DC REIT	シンガポール	投資証券	13,343,813	108.26 1,444,638,558	116.97 1,560,873,844	1.47
28	INVESTA OFFICE FUND	オーストラリア	投資証券	4,080,104	393.73 1,606,524,587	381.88 1,558,136,636	1.46
29	MIRVAC GROUP	オーストラリア	投資証券	7,801,912	201.91 1,575,338,665	189.62 1,479,448,486	1.39
30	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	56,465	28,520.38 1,610,403,618	24,668.13 1,392,886,102	1.31

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□ . 投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	96.57%

合計	96.57%
----	--------

(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	豪ドル買/円売 2018年2月	買建	5,191,825	456,994,737	455,738,373	0.43%
		英ポンド買/円売 2018年2月	買建	380,695	58,603,408	58,611,840	0.06%
		米ドル買/円売 2018年2月	買建	3,482,238	379,400,500	378,797,875	0.36%
		ユーロ売/円買 2018年2月	売建	2,808,710	379,400,500	379,400,500	0.36%
		米ドル売/円買 2018年2月	売建	4,739,389	515,598,145	515,550,751	0.48%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワJ - REITアクティブ・マザーファンド

(1) 投資状況 (平成30年1月31日現在)

投資状況

投資資産の種類	時価(円)	投資比率(%)
投資証券	96,138,698,700	98.24
内 日本	96,138,698,700	98.24
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	1,718,646,317	1.76
純資産総額	97,857,345,017	100.00

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

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

(2) 投資資産 (平成30年1月31日現在)

投資有価証券の主要銘柄

イ．主要銘柄の明細

	銘柄名	地域	数 種類 は	株数、口 また 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	13,072	528,284.44 6,905,734,288	561,000.00 7,333,392,000	7.49

2	野村不動産マスターF	日本	投資証券	43,069	138,947.83 5,984,344,148	152,000.00 6,546,488,000	6.69
3	日本プロロジスリート	日本	投資証券	20,899	236,826.01 4,949,426,825	250,500.00 5,235,199,500	5.35
4	日本ビルファンド	日本	投資証券	8,943	536,000.00 4,793,448,000	585,000.00 5,231,655,000	5.35
5	オリックス不動産投資	日本	投資証券	21,199	153,382.51 3,251,555,992	168,100.00 3,563,551,900	3.64
6	API投資法人	日本	投資証券	6,914	447,266.15 3,092,398,203	485,500.00 3,356,747,000	3.43
7	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	41,328	75,238.54 3,109,458,736	80,900.00 3,343,435,200	3.42
8	日本リートファンド	日本	投資証券	15,272	199,068.73 3,040,177,781	217,500.00 3,321,660,000	3.39
9	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	16,960	160,090.06 2,715,127,434	172,500.00 2,925,600,000	2.99
10	森ヒルズリート	日本	投資証券	21,092	131,312.94 2,769,652,535	137,100.00 2,891,713,200	2.96
11	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	7,129	369,443.14 2,633,760,205	386,000.00 2,751,794,000	2.81
12	大和ハウズリート投資法人	日本	投資証券	9,937	258,100.00 2,564,739,700	268,200.00 2,665,103,400	2.72
13	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	8,480	263,342.68 2,233,145,957	280,000.00 2,374,400,000	2.43
14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	3,446	591,186.01 2,037,227,005	689,000.00 2,374,294,000	2.43
15	イオンリート投資	日本	投資証券	18,019	113,618.42 2,047,290,404	119,500.00 2,153,270,500	2.20
16	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	11,798	159,880.14 1,886,265,922	171,200.00 2,019,817,600	2.06
17	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	13,514	125,841.62 1,700,623,708	148,500.00 2,006,829,000	2.05
18	日本リート投資法人	日本	投資証券	5,982	327,204.05 1,957,334,630	333,000.00 1,992,006,000	2.04
19	ラサールロジポート投資	日本	投資証券	15,782	110,689.32 1,746,898,904	117,900.00 1,860,697,800	1.90
20	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	7,264	226,485.53 1,645,190,921	246,600.00 1,791,302,400	1.83
21	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	12,720	130,739.98 1,663,012,605	139,000.00 1,768,080,000	1.81
22	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	33,062	46,943.69 1,552,052,405	50,600.00 1,672,937,200	1.71
23	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	18,497	78,780.95 1,457,211,334	86,200.00 1,594,441,400	1.63
24	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	437,732.71 1,391,552,316	494,500.00 1,572,015,500	1.61
25	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	3,445	439,882.76 1,515,396,128	456,000.00 1,570,920,000	1.61
26	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,480	548,245.56 1,359,649,010	630,000.00 1,562,400,000	1.60

27	コンフォリア・レジデンシャル	日本	投資証券	6,508	230,432.58 1,499,655,292	239,300.00 1,557,364,400	1.59
28	森トラスト総合リート	日本	投資証券	9,539	159,508.39 1,521,550,545	162,900.00 1,553,903,100	1.59
29	インベスコ・オフィス・リート	日本	投資証券	12,376	108,489.86 1,342,670,544	124,200.00 1,537,099,200	1.57
30	GLP投資法人	日本	投資証券	11,614	111,835.14 1,298,853,502	126,600.00 1,470,332,400	1.50

(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	98.24%
合計	98.24%

(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。

[次へ](#)

(参考情報) 運用実績

『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）

2018年1月31日現在

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

基準価額・純資産の推移

基準価額	10,325円
純資産総額	1.1億円

基準価額の騰落率	
期間	ファンド
1カ月間	-0.5%
3カ月間	2.8%
6カ月間	8.2%
1年間	13.9%
3年間	12.7%
5年間	58.6%
設定来	38.0%



※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実質的な運用管理費用(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: 140円 設定来分配金合計額: 2,340円

決算期	第57期	第58期	第59期	第60期	第61期	第62期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期	第68期
	16年3月	16年5月	16年7月	16年9月	16年11月	17年1月	17年3月	17年5月	17年7月	17年9月	17年11月	18年1月
分配金	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30円	30円	20円	20円	20円	20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	業種・用途名	比率	
国内株式	78	42.1%	日本円	50.7%	直接利回り(%)	ソニー	電気機器	1.9%	
外国債券	36	38.8%	米ドル	14.1%	最終利回り(%)	三菱UFJフィナンシャルG	銀行業	1.8%	
外国リート	76	9.3%	ユーロ	10.6%	修正デュレーション	ビジョン	その他製品	1.5%	
国内リート	51	4.9%	カナダ・ドル	6.8%	残存年数	信越化学	化学	1.3%	
			英ポンド	5.9%	債券格付別構成 比率	日本電産	電気機器	1.2%	
			豪ドル	5.0%	AAA	81.7%	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産	0.4%
			ポーランド・ズロチ	2.9%	AA	-	野村不動産マスターF	各種不動産	0.3%
			スウェーデン・クローネ	1.5%	A	18.3%	DEXUS	オフィス	0.3%
			デンマーク・クローネ	1.2%	BBB	-	GOODMAN GROUP	産業施設	0.3%
コール・ローン、その他		4.9%	その他	1.3%	BB	-	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	各種不動産	0.3%
合計	241	100.0%	合計	100.0%	合計	100.0%	合計	9.2%	

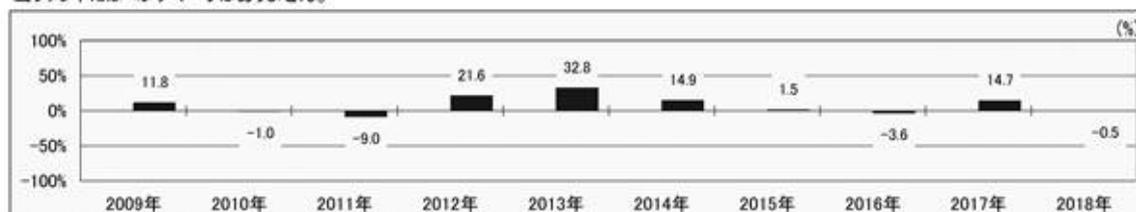
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

※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。

※業種・用途名について、株式は東証33業種分類、国内リートは世界産業分類基準(GICS)、外国リートはS&P Global Property Indexの分類を原則としています。

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1月31日までの騰落率を表しています。

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

第2 【管理及び運営】

1 【申込（販売）手続等】

<更新後>

<略>

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはI C Eフューチャーズ・ヨーロッパのいずれかの休業日と同じ日付の日を取得申込受付日とする受益権の取得申込みの受け付けを行いません。

<略>

2 【換金（解約）手続等】

<更新後>

<略>

ただし、販売会社は、ニューヨーク証券取引所またはI C Eフューチャーズ・ヨーロッパのいずれかの休業日と同じ日付の日を一部解約請求受付日とする一部解約の実行の請求の受け付けを行いません。

<略>

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間（平成29年7月19日から平成30年1月15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】

『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）

(1) 【貸借対照表】

	前 期	当 期
	平成29年7月18日現在	平成30年1月15日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,621,059	1,688,081
投資信託受益証券	55,746,056	55,427,037
親投資信託受益証券	67,568,520	65,031,360
未収入金	-	1,000,000
流動資産合計	124,935,635	123,146,478
資産合計	124,935,635	123,146,478
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	258,851	232,158
未払解約金	518	969,293
未払受託者報酬	11,722	11,185
未払委託者報酬	223,037	212,867
その他未払費用	5,028	4,921
流動負債合計	499,156	1,430,424
負債合計	499,156	1,430,424
純資産の部		
元本等		
元本	1 129,425,619	116,079,091
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	2 4,989,140	5,636,963
(分配準備積立金)	2,067,779	6,447,722
元本等合計	124,436,479	121,716,054
純資産合計	124,436,479	121,716,054
負債純資産合計	124,935,635	123,146,478

(2) 【損益及び剰余金計算書】

	前 期	当 期
	自 平成29年1月17日 至 平成29年7月18日	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月15日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取配当金	492,344	458,977
有価証券売買等損益	6,906,641	11,743,821
営業収益合計	7,398,985	12,202,798
営業費用		
支払利息	348	297
受託者報酬	34,059	33,337
委託者報酬	1 647,973	634,441
その他費用	5,028	4,921
営業費用合計	687,408	672,996
営業利益	6,711,577	11,529,802
経常利益	6,711,577	11,529,802
当期純利益	6,711,577	11,529,802
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	120,116	109,610
期首剰余金又は期首欠損金 ()	11,429,429	4,989,140
剰余金増加額又は欠損金減少額	941,533	-
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額	941,533	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,651	54,167
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	-	51,179
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	20,651	2,988
分配金	2 1,072,054	739,922
期末剰余金又は期末欠損金 ()	4,989,140	5,636,963

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 平成29年7月19日	至 平成30年1月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	(1)投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、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。 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	(2)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。	
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	受取配当金 原則として、投資信託受益証券の配当落ち日において、確定配当金額を計上しております。	
	特定期間末日 平成29年7月15日、その翌日及びその翌々日が休日のため、前特定期間末日を平成29年7月18日としております。このため、当特定期間は181日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成29年7月18日現在	平成30年1月15日現在
1. 1 期首元本額	142,002,823円	129,425,619円
期中追加設定元本額	284,953円	173,743円
期中一部解約元本額	12,862,157円	13,520,271円
2. 特定期間末日における受益権の総数	129,425,619口	116,079,091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4,989,140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1月17日 至 平成29年7月18日	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月15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	29,698円	29,063円

2. 2 分配金の計算過程

<p>（自平成29年1月17日 至平成29年3月15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（267,617円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,853,861円）及び分配準備積立金（1,942,645円）より分配対象額は4,064,123円（1万口当たり292.64円）であり、うち416,627円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年7月19日 至平成29年9月15日） 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（261,677円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,723,829円）及び分配準備積立金（2,058,154円）より分配対象額は4,043,660円（1万口当たり313.75円）であり、うち257,766円（1万口当たり20円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年9月16日 至平成29年11月15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（273,612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（1,604,654円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,672,835円）及び分配準備積立金（1,999,006円）より分配対象額は5,550,107円（1万口当たり444.01円）であり、うち249,998円（1万口当たり20円）を分配金額としております。</p>
<p>（自平成29年3月16日 至平成29年5月15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（294,284円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,765,884円）及び分配準備積立金（1,706,142円）より分配対象額は3,766,310円（1万口当たり284.91円）であり、うち396,576円（1万口当たり30円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年5月16日 至平成29年7月18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（757,440円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,730,081円）及び分配準備積立金（1,569,190円）より分配対象額は4,056,711円（1万口当たり313.44円）であり、うち258,851円（1万口当たり20円）を分配金額としております。</p>	<p>（自平成29年11月16日 至平成30年1月15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（723,253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（2,589,653円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,554,959円）及び分配準備積立金（3,366,974円）より分配対象額は8,234,839円（1万口当たり709.42円）であり、うち232,158円（1万口当たり20円）を分配金額としております。</p>

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	当 期 自 平成29年7月19日 至 平成30年1月15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、投資信託受益証券及び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1月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	前 期 平成29年7月18日現在	当 期 平成30年1月15日現在
	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	1,709,643	2,989,348
親投資信託受益証券	1,345,040	47,782
合計	3,054,683	3,037,130

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期 平成29年7月18日現在	当 期 平成30年1月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

当 期 自 平成29年7月19日 至 平成30年1月15日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	前 期 平成29年7月18日現在	当 期 平成30年1月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	0.9615円 (9,615円)	1.0486円 (10,486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
投資信託受益証券	(F0Fs専用)ダイワSRIファンド(適格機関投資家専用)	40,671,439	55,427,037	
投資信託受益証券 合計			55,427,037	
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	27,737,407	47,555,784	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	5,211,062	11,506,024	
	ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド	2,504,007	5,969,552	
親投資信託受益証券 合計			65,031,360	
合計			120,458,397	

投資信託受益証券及び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、「(F0Fs専用)ダイワSRIファンド(適格機関投資家専用)」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「投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

また、当ファンドは、「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」受益証券、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」受益証券及び「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、同ファンドの状況及び当ファンドの特定期間末日（以下、「期末日」）における同マザーファンドの状況は次のとおりであります。

[次へ](#)

「(FOfs専用)ダイワSRIファンド（適格機関投資家専用）」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

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、第22期計算期間（平成29年5月20日から平成29年11月20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。

その監査報告書は、該当する財務諸表の直前に添付しております。

財務諸表

（FOfs専用）ダイワSRIファンド（適格機関投資家専用）

(1) 貸借対照表

	第21期 平成29年5月19日現在	第22期 平成29年11月20日現在
	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	273,706	267,617
親投資信託受益証券	54,152,056	59,107,236
流動資産合計	54,425,762	59,374,853
資産合計	54,425,762	59,374,853
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	492,344	458,977
未払受託者報酬	18,663	18,362
未払委託者報酬	227,622	223,996
その他未払費用	1,469	1,475
流動負債合計	740,098	702,810
負債合計	740,098	702,810
純資産の部		
元本等		
元本	1 49,234,421	45,897,746
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,451,243	12,774,297

（分配準備積立金）	8,504,489	15,481,196
元本等合計	53,685,664	58,672,043
純資産合計	53,685,664	58,672,043
負債純資産合計	54,425,762	59,374,853

(2) 損益及び剰余金計算書

	第21期 自 平成28年11月22日 至 平成29年5月19日	第22期 自 平成29年5月20日 至 平成29年11月20日
	金額（円）	金額（円）
営業収益		
有価証券売買等損益	5,900,889	9,689,180
営業収益合計	5,900,889	9,689,180
営業費用		
受託者報酬	18,663	18,362
委託者報酬	227,622	223,996
その他費用	1,469	1,475
営業費用合計	247,754	243,833
営業利益	5,653,135	9,445,347
経常利益	5,653,135	9,445,347
当期純利益	5,653,135	9,445,347
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	804,046	361,652
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	114,029	4,451,243
剰余金減少額又は欠損金増加額	19,531	301,664
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	19,531	301,664
分配金 1	492,344	458,977
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,451,243	12,774,297

(3) 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	第22期 自 平成29年5月20日 至 平成29年11月20日
1. 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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日

平成29年11月19日が休日のため、当計算期間末日を平成29年11月20日としております。このため、当計算期間は185日となっております。

（貸借対照表に関する注記）

区 分	第21期 平成29年5月19日現在	第22期 平成29年11月20日現在
1. 1 期首元本額	59,410,837円	49,234,421円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	10,176,416円	3,336,675円
2. 計算期間末日における受益 権の総数	49,234,421口	45,897,746口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第21期 自 平成28年11月22日 至 平成29年5月19日	第22期 自 平成29年5月20日 至 平成29年11月20日
1 分配金の計算過程	<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（504,727円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,737,897円）及び分配準備積立金（8,492,106円）より分配対象額は10,734,730円（1万口当たり2,180.33円）であり、うち492,344円（1万口当たり100円）を分配金額としております。</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（408,877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（7,603,165円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,620,118円）及び分配準備積立金（7,928,131円）より分配対象額は17,560,291円（1万口当たり3,825.96円）であり、うち458,977円（1万口当たり100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	第22期 自 平成29年5月20日 至 平成29年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。</p>
2. 金融商品の内容及びリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券に投資しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	第22期 平成29年11月20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	第21期 平成29年5月19日現在	第22期 平成29年11月20日現在
	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当計算期間の損益に 含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	5,055,567	9,299,913
合計	5,055,567	9,299,913

（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

第21期 平成29年5月19日現在	第22期 平成29年11月20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）

第22期 自 平成29年5月20日 至 平成29年11月20日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行われていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第21期 平成29年5月19日現在	第22期 平成29年11月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0904円 (10,904円)	1.2783円 (12,783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S R Iマザーファンド	25,962,943	59,107,236	
親投資信託受益証券 合計			59,107,236	
合計			59,107,236	

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。

参考情報

当ファンドは、「ダイワS R I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、当ファンドの計算期間末日（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S R Iマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年5月19日現在	平成29年11月20日現在
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	16,829,033	33,306,286
株式	595,536,800	719,951,200
未収入金	19,771,055	4,227,100
未収配当金	6,035,590	4,723,050
流動資産合計	638,172,478	762,207,636
資産合計	638,172,478	762,207,636

負債の部		
流動負債		
未払金	7,784,069	5,335,693
未払解約金	13,900,000	1,400,000
その他未払費用	28	-
流動負債合計	21,684,097	6,735,693
負債合計	21,684,097	6,735,693
純資産の部		
元本等		
元本	1 321,352,085	331,844,091
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	295,136,296	423,627,852
元本等合計	616,488,381	755,471,943
純資産合計	616,488,381	755,471,943
負債純資産合計	638,172,478	762,207,636

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年5月20日 至 平成29年11月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. 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29年5月19日現在	平成29年11月20日現在
1. 1 期首	平成28年11月22日	平成29年5月20日
期首元本額	332,126,061円	321,352,085円
期中追加設定元本額	26,300,331円	25,601,208円
期中一部解約元本額	37,074,307円	15,109,202円
期末元本額の内訳		
ファンド名		

(FOFs専用) ダイワ S R I ファンド (適格機関投資家専 用)	28,227,719円	25,962,943円
DC・ダイワ S R I ファンド	293,124,366円	305,881,148円
計	321,352,085円	331,844,091円
2. 期末日における受益権の総数	321,352,085口	331,844,091口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年5月20日 至 平成29年11月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。
2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。 これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。
4. 金融商品の時価等に関する事項 についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成29年11月20日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表 計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成29年5月19日現在	平成29年11月20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	76,208,109	101,196,080
合計	76,208,109	101,196,080

(注) 「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成28年5月20日から平成29年5月19日まで、及び平成29年5月20日から平成29年11月20日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成29年5月19日現在	平成29年11月20日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	平成29年5月19日現在	平成29年11月20日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9184円 (19,184円)	2.2766円 (22,766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	
マルハニチロ	500	3,130.00	1,565,000	
前田建設	7,000	1,651.00	11,557,000	
ピーエス三菱	16,000	884.00	14,144,000	
五洋建設	8,000	821.00	6,568,000	
大和ハウス	3,000	4,028.00	12,084,000	
日本工営	1,600	3,830.00	6,128,000	
森永製菓	500	5,730.00	2,865,000	
ディー・エヌ・エー	2,500	2,689.00	6,722,500	
ニチレイ	3,900	3,140.00	12,246,000	
東レ	14,000	1,141.50	15,981,000	
クレハ	700	6,740.00	4,718,000	
信越化学	1,900	12,205.00	23,189,500	
三井化学	5,400	3,475.00	18,765,000	
東京応化工業	700	4,965.00	3,475,500	
三菱ケミカルHLDGS	10,000	1,155.00	11,550,000	
宇部興産	1,800	3,255.00	5,859,000	
花王	2,300	6,931.00	15,941,300	
三洋化成	700	5,690.00	3,983,000	
塩野義製薬	900	6,264.00	5,637,600	
テルモ	1,500	5,010.00	7,515,000	
オリエンタルランド	1,200	9,644.00	11,572,800	
資生堂	800	5,163.00	4,130,400	
ファンケル	800	3,170.00	2,536,000	
出光興産	1,100	3,505.00	3,855,500	
JXTGホールディングス	8,000	602.20	4,817,600	
コスモエネルギーHLDGS	1,800	3,030.00	5,454,000	
三井金属	1,500	6,860.00	10,290,000	

三菱マテリアル	500	4,005.00	2,002,500
住友鉱山	2,300	4,417.00	10,159,100
DOWAホールディングス	1,000	4,380.00	4,380,000
古河電工	1,200	6,000.00	7,200,000
住友電工	2,000	1,892.50	3,785,000
タクマ	2,000	1,544.00	3,088,000
ディスコ	900	27,400.00	24,660,000
LITALICO	3,500	1,670.00	5,845,000
豊田自動織機	1,200	6,820.00	8,184,000
平田機工	400	12,490.00	4,996,000
サト-ホールディングス	800	2,926.00	2,340,800
荏原製作所	600	4,485.00	2,691,000
ダイキン工業	1,300	12,760.00	16,588,000
ダイフク	2,700	6,170.00	16,659,000
日本ピストンリング	3,400	2,212.00	7,520,800
日立	14,000	843.80	11,813,200
日本電産	1,300	15,655.00	20,351,500
オムロン	600	6,860.00	4,116,000
富士通	7,000	823.80	5,766,600
セイコーエプソン	3,900	2,669.00	10,409,100
パナソニック	500	1,695.50	847,750
ソニー	6,500	5,248.00	34,112,000
TDK	200	8,700.00	1,740,000
タムラ製作所	6,000	776.00	4,656,000
リオン	1,800	2,347.00	4,224,600
堀場製作所	300	7,350.00	2,205,000
デンソー	700	6,455.00	4,518,500
ローム	2,200	12,410.00	27,302,000
太陽誘電	1,400	1,880.00	2,632,000
村田製作所	500	15,820.00	7,910,000
トヨタ自動車	2,300	6,931.00	15,941,300
フタバ産業	5,000	1,016.00	5,080,000
ヤマハ発動機	1,100	3,545.00	3,899,500
島津製作所	3,300	2,670.00	8,811,000
信越ポリマー	4,800	1,163.00	5,582,400
任天堂	300	44,770.00	13,431,000
伊藤忠	6,000	1,897.50	11,385,000
豊田通商	1,300	4,100.00	5,330,000
東京エレクトロン	600	22,710.00	13,626,000
日立ハイテクノロジーズ	1,800	4,990.00	8,982,000
住友商事	3,100	1,648.50	5,110,350
三菱商事	2,100	2,757.00	5,789,700
三菱UFJフィナンシャルG	38,000	735.20	27,937,600
三井住友フィナンシャルG	2,200	4,337.00	9,541,400

オリックス	4,800	1,856.50	8,911,200	
野村ホールディングス	6,000	632.80	3,796,800	
第一生命HLDGS	2,700	2,146.00	5,794,200	
東京海上HD	2,800	4,840.00	13,552,000	
三井不動産	2,000	2,545.50	5,091,000	
西日本旅客鉄道	1,000	7,774.00	7,774,000	
ANAホールディングス	1,100	4,354.00	4,789,400	
日本電信電話	2,200	5,766.00	12,685,200	
SCSK	1,000	5,180.00	5,180,000	
ファーストリテイリング	400	40,190.00	16,076,000	
合計			719,951,200	

(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。

[次へ](#)

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年7月18日現在	平成30年1月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	219,944,152	101,892,937
コール・ローン	44,766,160	21,349,023
国債証券	29,958,953,715	30,791,626,199
特殊債券	1,696,096,831	1,018,084,786
派生商品評価勘定	94,675,846	18,930,000
未収入金	109,545,633	206,090,414
未収利息	249,874,207	307,227,110
前払費用	7,213,919	10,254,194
差入委託証拠金	249,464,536	254,215,169
流動資産合計	32,630,534,999	32,729,669,832
資産合計	32,630,534,999	32,729,669,832
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	62,131,595	34,917,267
未払解約金	71,545,621	7,486,214
その他未払費用	10,800	-
流動負債合計	133,688,016	42,403,481
負債合計	133,688,016	42,403,481
純資産の部		
元本等		
元本	1 19,374,954,416	19,065,320,764
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	13,121,892,567	13,621,945,587
元本等合計	32,496,846,983	32,687,266,351
純資産合計	32,496,846,983	32,687,266,351
負債純資産合計	32,630,534,999	32,729,669,832

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券及び特殊債券</p> <p>個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<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。 時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
<p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成29年7月18日現在	平成30年1月15日現在
<p>1. 1 期首 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額</p>	<p>平成29年1月17日 23,323,069,104円 350,724,224円 4,298,838,912円</p>	<p>平成29年7月19日 19,374,954,416円 1,811,177,512円 2,120,811,164円</p>
<p>期末元本額の内訳 ファンド名</p>		
<p>ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）</p>	2,053,595,338円	1,928,754,562円
<p>富山応援ファンド（地域企業株・外債バランス/毎月分配型）</p>	693,069,451円	676,574,075円
<p>ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）</p>	1,146,967,092円	1,060,099,251円
<p>ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）</p>	53,964,308円	51,858,814円
<p>安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）</p>	227,574,254円	206,952,507円
<p>インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）</p>	436,701,607円	375,974,332円
<p>成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）</p>	605,236,674円	569,160,341円
<p>京都応援バランスファンド（隔月分配型）</p>	260,083,725円	245,006,438円
<p>6資産バランスファンド（分配型）</p>	1,322,626,976円	1,186,215,809円
<p>6資産バランスファンド（成長型）</p>	133,909,232円	127,996,592円
<p>ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）</p>	9,074,587,002円	8,300,737,309円
<p>世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）</p>	84,220,941円	75,947,715円
<p>ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）</p>	433,739,770円	385,172,140円
<p>兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）</p>	1,091,134,034円	977,341,727円

『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	29,726,151円	27,737,407円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	326,234,511円	298,690,600円
紀陽地域株式・外債バランスファンド（隔月分配型）	61,122,781円	57,398,918円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	1,323,306,924円	1,210,540,915円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（1年決算型）	17,153,645円	17,014,377円
四国アライアンス 地域創生ファンド（年1回決算型）	- 円	849,917,751円
四国アライアンス 地域創生ファンド（年2回決算型）	- 円	436,229,184円
計	19,374,954,416円	19,065,320,764円
2. 期末日における受益権の総数	19,374,954,416口	19,065,320,764口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月15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1月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成29年7月18日現在	平成30年1月15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	152,590,658	153,128,563
特殊債券	22,395,073	2,097,441
合計	174,985,731	155,226,004

(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4月11日から平成29年7月18日まで、及び平成29年10月11日から平成30年1月15日まで）を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成29年7月18日 現在				平成30年1月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	10,085,327,135	-	10,122,539,719	37,212,584	1,874,740,000	-	1,855,810,000	18,930,000
オーストラリア・ドル	5,560,960,000	-	5,599,360,000	38,400,000	1,332,900,000	-	1,315,050,000	17,850,000
カナダ・ドル	2,909,949,756	-	2,909,634,840	314,916	-	-	-	-
スウェーデン・クローナ	516,239,879	-	516,239,879	0	-	-	-	-
ユーロ	1,098,177,500	-	1,097,305,000	872,500	541,840,000	-	540,760,000	1,080,000
買 建	9,931,982,935	-	10,001,739,770	69,756,835	1,874,740,000	-	1,839,822,733	34,917,267
オーストラリア・ドル	2,821,303,056	-	2,800,960,000	20,343,056	-	-	-	-
カナダ・ドル	5,560,960,000	-	5,645,914,180	84,954,180	1,332,900,000	-	1,299,474,909	33,425,091
スウェーデン・クローナ	1,033,480,000	-	1,038,505,590	5,025,590	541,840,000	-	540,347,824	1,492,176
ユーロ	516,239,879	-	516,360,000	120,121	-	-	-	-
合計	20,017,310,070	-	20,124,279,489	32,544,251	3,749,480,000	-	3,695,632,733	15,987,267

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

- (2) 期末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、期末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成29年7月18日現在	平成30年1月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6773円 (16,773円)	1.7145円 (17,145円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	アメリカ・ドル	1.5% United States Treasury Note/Bond 20191031	7,000,000.000	6,939,520.000		
		2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	8,000,000.000	7,851,840.000		
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	45,000,000.000	42,057,000.000		
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	7,900,000.000	7,361,773.000		
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	7,200,000.000	7,019,424.000		
	アメリカ・ドル	小計			アメリカ・ドル 71,229,557.000 (7,899,357,871)	
	イギリス・ポンド		2% United Kingdom Gilt 20200722	300,000.000	310,218.000	
			1.5% United Kingdom Gilt 20210122	3,700,000.000	3,789,762.000	
			1.5% United Kingdom Gilt 20260722	4,500,000.000	4,591,620.000	
			5% United Kingdom Gilt 20250307	9,300,000.000	11,786,355.000	
			4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	1,532,000.000	
			4% United Kingdom Gilt 20220307	1,500,000.000	1,696,860.000	
	イギリス・ポンド	小計			イギリス・ポンド 23,706,815.000 (3,611,496,196)	
	オーストラリア・ドル		5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	8,000,000.000	8,913,520.000	
			4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	6,800,000.000	7,935,532.000	
			4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	24,000,000.000	28,417,680.000	
	オーストラリア・ドル	小計			オーストラリア・ドル 45,266,732.000 (3,972,608,400)	
	カナダ・ドル			カナダ・ドル	カナダ・ドル	

	3.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20451201	1,500,000.000	1,840,065.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	19,000,000.000	19,181,070.000	
	1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	13,500,000.000	12,831,885.000	
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 33,853,020.000 (3,011,226,130)	
スウェーデン・ク ローナ	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	10,000,000.000	11,545,800.000	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	36,000,000.000	38,601,360.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 50,147,160.000 (690,024,921)	
デンマーク・ク ローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,500,000.000	9,184,945.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	38,500,000.000	42,724,990.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 51,909,935.000 (942,165,320)	
ノルウェー・ク ローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	3,000,000.000	3,278,100.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	4,000,000.000	4,158,840.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	20,000,000.000	21,972,800.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 29,409,740.000 (411,148,165)	
ポーランド・ズロ チ	2.25% Poland Government Bond 20220425	27,000,000.000	26,816,400.000	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	40,000,000.000	45,084,000.000	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 71,900,400.000 (2,330,291,964)	
ユーロ	0.8% Belgium Government Bond 20250622	10,300,000.000	10,577,070.000	
	1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	2,800,000.000	3,022,908.000	
	2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,500,000.000	1,942,020.000	
	3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	5,200,000.000	6,995,976.000	
	2.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20240525	7,500,000.000	8,452,875.000	
	3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,500,000.000	2,213,445.000	
	5.4% IRISH TREASURY 20250313	12,800,000.000	17,214,080.000	
	1% IRISH TREASURY 20260515	8,000,000.000	8,194,640.000	
ユーロ 小計			ユーロ 58,613,014.000	

				(7,923,307,232)		
国債証券	合計			30,791,626,199	[30,791,626,199]	
特殊債券	カナダ・ドル	2.55% CANADA HOUSING TRUST 20250315	カナダ・ドル	カナダ・ドル		
			4,500,000.000	4,542,885.000		
		2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215		7,000,000.000	6,902,700.000	
	カナダ・ドル	小計			カナダ・ドル	
				11,445,585.000	(1,018,084,786)	
特殊債券	合計			1,018,084,786	[1,018,084,786]	
合計				31,809,710,985	[31,809,710,985]	

- (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%	24.8%
イギリス・ポンド	国債証券 6銘柄	100%	11.4%
オーストラリア・ドル	国債証券 3銘柄	100%	12.5%
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄	100%	12.7%
	特殊債券 2銘柄		
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	100%	2.2%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	100%	3.0%
ノルウェー・クローネ	国債証券 3銘柄	100%	1.3%
ポーランド・ズロチ	国債証券 2銘柄	100%	7.3%
ユーロ	国債証券 8銘柄	100%	24.8%

第2 信用取引契約残高明細表
 該当事項はありません。

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

[次へ](#)

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年7月18日現在	平成30年1月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	3,217,904,678	3,621,111,192
コール・ローン	732,871,760	327,217,501
投資証券	111,410,920,803	104,537,707,000
派生商品評価勘定	2,145,000	927,677
未収入金	1,457,876,382	511,627,178
未収配当金	449,866,094	493,905,968
流動資産合計	117,271,584,717	109,492,496,516
資産合計	117,271,584,717	109,492,496,516
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	1,793,525
未払金	1,671,856,837	491,007,067
未払解約金	161,000,000	95,076,000
その他未払費用	10,800	-
流動負債合計	1,832,867,637	587,876,592
負債合計	1,832,867,637	587,876,592
純資産の部		
元本等		
元本	1	53,644,868,925
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		61,793,848,155
元本等合計		115,438,717,080
純資産合計		115,438,717,080
負債純資産合計		109,492,496,516

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	為替予約取引

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分		平成29年7月18日現在	平成30年1月15日現在
1.	1 期首	平成29年1月17日	平成29年7月19日
	期首元本額	60,364,494,827円	53,644,868,925円
	期中追加設定元本額	61,213,041円	296,766,181円
	期中一部解約元本額	6,780,838,943円	4,618,254,082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)	48,701,936,918円	44,745,991,013円
	ダイワ・バランス3資産(外債・海外リート・好配当日本株)	42,231,901円	39,191,006円
	安定重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	24,965,498円	21,809,358円
	インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	23,569,111円	19,940,781円
	成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	116,511,181円	107,031,757円
	6資産バランスファンド(分配型)	202,836,610円	178,981,256円
	6資産バランスファンド(成長型)	423,714,200円	391,872,890円
	りそな ワールド・リート・ファンド	2,135,801,326円	1,904,417,901円
	世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	64,701,246円	57,412,853円
	『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	5,657,671円	5,211,062円
	常陽3分法ファンド	312,266,765円	278,623,546円
	ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	72,597,564円	64,952,916円

DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	195,590,701円	207,685,698円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	267,999,506円	280,372,248円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	321,688,566円	349,435,566円
ダイワ・グローバルREITファンド(ダイワSMA専用)	47,486,876円	62,698,631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)	618,793,604円	542,272,184円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド(部分為替ヘッジあり)	28,406,770円	28,146,594円
ダイワ外国3資産バランス・ファンド(為替ヘッジなし)	38,112,911円	37,333,764円
計	53,644,868,925円	49,323,381,024円
2. 期末日における受益権の総数	53,644,868,925口	49,323,381,024口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月15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1月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)デリバティブ取引

デリバティブ取引に関する注記に記載しております。

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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	平成29年7月18日現在	平成30年1月15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	5,808,535,162	484,444,113
合計	5,808,535,162	484,444,113

(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16日から平成29年7月18日まで、及び平成29年9月16日から平成30年1月15日まで)を指しております。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

種 類	平成29年7月18日 現在				平成30年1月15日 現在			
	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	226,985,000	-	224,840,000	2,145,000	609,957,934	-	610,310,879	352,945
アメリカ・ドル	226,985,000	-	224,840,000	2,145,000	463,970,858	-	463,172,587	798,271
イギリス・ポンド	-	-	-	-	145,987,076	-	147,138,292	1,151,216
買 建	-	-	-	-	331,976,434	-	331,463,531	512,903
アメリカ・ドル	-	-	-	-	145,987,076	-	145,346,529	640,547
ユーロ	-	-	-	-	185,989,358	-	186,117,002	127,644
合計	226,985,000	-	224,840,000	2,145,000	941,934,368	-	941,774,410	865,848

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報)

	平成29年7月18日現在	平成30年1月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.1519円 (21,519円)	2.2080円 (22,080円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	204,291	7,756,929.270	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	147,527	24,417,193.770	
		BOSTON PROPERTIES INC	150,568	18,418,983.440	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	268,099	10,890,181.380	
		GGP INC	359,547	8,337,894.930	
		EQUITY RESIDENTIAL	322,970	19,513,847.400	
		EPR PROPERTIES	141,740	8,450,538.800	
		EQUINIX INC	17,691	7,712,391.450	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	288,006	6,940,944.600	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	734,106	14,946,398.160	
		GRAMERCY PROPERTY TRUST	351,015	9,150,961.050	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	193,267	6,352,686.290	
		RLJ LODGING TRUST	338,620	7,497,046.800	
		PHYSICIANS REALTY TRUST	978,661	15,991,320.740	
		CYRUSONE INC	106,284	5,873,253.840	
		HEALTHCARE TRUST OF AME-CL A	239,038	6,523,347.020	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	188,652	6,793,358.520	
		INVITATION HOMES INC	411,570	9,346,754.700	
		EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	445,431	8,463,189.000	
		VENTAS INC	3,589	196,784.870	
		GEO GROUP INC/THE	302,267	6,861,460.900	
		CROWN CASTLE INTL CORP	220,457	22,832,731.490	
		SUN COMMUNITIES INC	215,149	18,758,841.310	
		PROLOGIS INC	111,219	6,878,895.150	
		COUSINS PROPERTIES INC	1,100,283	9,902,547.000	
		DDR CORP	582,036	4,999,689.240	
		DUKE REALTY CORP	339,289	8,723,120.190	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	56,465	12,823,201.500	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	56,752	6,969,713.120	
		HCP INC	46,399	1,096,872.360	
		KILROY REALTY CORP	216,738	15,507,603.900	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	113,473	10,362,354.360	
		REGENCY CENTERS CORP	176,553	11,309,985.180	
		UDR INC	675,816	24,126,631.200	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	178,769	4,669,446.280			
CUBESMART	344,454	9,403,594.200			
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	572,450	9,525,568.000			
DIGITAL REALTY TRUST INC	217,576	23,015,189.280			
EXTRA SPACE STORAGE INC	114,194	9,392,456.500			
EDUCATION REALTY TRUST INC	267,549	8,877,275.820			
DOUGLAS EMMETT INC	283,337	10,868,807.320			
	アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 440,479,990.330 (48,849,230,928)	
	イギリス・ポンド			イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	18,962,702	11,965,464.960		

	SEGR0 PLC	3,112,251	17,882,994.240
	HAMMERSON PLC	442,657	2,284,995.430
	UNITE GROUP PLC	709,470	5,704,138.800
	BRITISH LAND CO PLC	1,614,900	10,868,277.000
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	656,412	4,319,190.960
	DERWENT LONDON PLC	151,714	4,528,662.900
	WORKSPACE GROUP PLC	296,911	2,851,830.150
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	1,127,069	5,445,997.400
	BIG YELLOW GROUP PLC	544,738	4,534,943.850
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	2,564,764	4,616,575.200
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	3,783,955	5,657,012.720
イギリス・ポンド	小計		イギリス・ポンド 80,660,083.610 (12,287,757,137)
オーストラリア・ドル			オーストラリア・ドル
	NATIONAL STORAGE REIT	13,294,696	20,008,517.480
	SCENTRE GROUP	2,346,553	9,573,936.240
	DEXUS	4,734,579	46,446,219.990
	INVESTA OFFICE FUND	4,080,104	18,278,865.920
	MIRVAC GROUP	10,367,637	23,327,183.250
	GOODMAN GROUP	5,008,951	40,722,771.630
	CHARTER HALL GROUP	2,435,532	14,491,415.400
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	7,578,273	21,219,164.400
オーストラリア・ドル	小計		オーストラリア・ドル 194,068,074.310 (17,031,414,202)
カナダ・ドル			カナダ・ドル
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	250,382	11,139,495.180
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	501,527	20,738,141.450
カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 31,877,636.630 (2,835,515,779)
シンガポール・ドル			シンガポール・ドル
	KEPPEL DC REIT	13,343,813	19,348,528.850
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	3,027,600	8,447,004.000
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	4,182,500	12,505,675.000
シンガポール・ドル	小計		シンガポール・ドル 40,301,207.850 (3,376,435,194)
ユーロ			ユーロ
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	934,255	11,827,668.300
	UNIBAIL-RODAMCO SE	97,402	19,908,968.800
	GECINA SA	154,277	23,619,808.700
	FONCIERE DES REGIONS	155,876	13,670,325.200
	AEDIFICA	34,332	2,653,863.600
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	431,247	3,646,193.380
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	253,338	4,086,341.940
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	3,064,758	34,723,708.140
ユーロ	小計		ユーロ 114,136,878.060 (15,429,023,176)
香港・ドル			香港・ドル
	FORTUNE REIT	13,833,070	133,765,786.900
	LINK REIT	2,834,420	199,684,889.000
香港・ドル	小計		香港・ドル 333,450,675.900 (4,728,330,584)
投資証券	合計		104,537,707,000

		[104,537,707,000]	
合計		104,537,707,000	
		[104,537,707,000]	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

- (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%	46.7%
イギリス・ポンド	投資証券 12銘柄	100%	11.8%
オーストラリア・ドル	投資証券 8銘柄	100%	16.3%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	100%	2.7%
シンガポール・ドル	投資証券 3銘柄	100%	3.2%
ユーロ	投資証券 8銘柄	100%	14.8%
香港・ドル	投資証券 2銘柄	100%	4.5%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

[次へ](#)

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成29年7月18日現在	平成30年1月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,000,741,827	1,858,244,620
投資証券	77,459,326,500	92,489,266,900
未収入金	-	295,361,365
未収配当金	541,669,700	875,426,956
流動資産合計	80,001,738,027	95,518,299,841
資産合計	80,001,738,027	95,518,299,841
負債の部		
流動負債		
未払金	213,994,365	332,855,747
未払解約金	1,600,000	262,000
流動負債合計	215,594,365	333,117,747
負債合計	215,594,365	333,117,747
純資産の部		
元本等		
元本	1 36,101,464,750	39,926,017,275
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	43,684,678,912	55,259,164,819
元本等合計	79,786,143,662	95,185,182,094
純資産合計	79,786,143,662	95,185,182,094
負債純資産合計	80,001,738,027	95,518,299,841

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認められた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認められた価額で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、投資証券の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成29年7月18日現在	平成30年1月15日現在
1. 1 期首	平成29年1月17日	平成29年7月19日
期首元本額	32,195,471,219円	36,101,464,750円
期中追加設定元本額	4,478,644,191円	4,402,158,115円

期中一部解約元本額	572,650,660円	577,605,590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)	23,305,297円	21,568,970円
インカム重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	20,672,094円	19,794,359円
成長重視ポートフォリオ(奇数月分配型)	105,480,178円	105,046,049円
6資産バランスファンド(分配型)	181,875,264円	176,275,746円
6資産バランスファンド(成長型)	374,785,397円	384,869,180円
世界6資産均等分散ファンド(毎月分配型)	59,431,666円	56,815,849円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン(奇数月分配型)	2,504,007円	2,504,007円
ダイワ資産分散インカムオープン(奇数月決算型)	65,171,339円	63,882,040円
成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-07	37,092,372円	26,550,226円
成果リレー(ブラジル国債&J-REIT)2014-08	44,407,102円	34,247,124円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	183,661,374円	203,465,812円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	250,332,937円	274,231,162円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	301,295,724円	342,804,809円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	443,989,018円	373,307,153円
ダイワファンドラップJ-REITセレクト	32,896,493,278円	36,775,020,054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)	151,330,458円	138,295,161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)	45,752,414円	44,466,302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)	241,850,156円	222,451,499円
ダイワ・アクティブJリート・ファンド(年4回決算型)	672,034,675円	660,421,773円
計	36,101,464,750円	39,926,017,275円
2. 期末日における受益権の総数	36,101,464,750口	39,926,017,275口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成29年7月19日 至 平成30年1月15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1月15日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成29年7月18日現在	平成30年1月15日現在
	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）	当期間の損益に 含まれた評価差額（円）
投資証券	6,963,832,293	5,473,155,682
合計	6,963,832,293	5,473,155,682

（注）「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から期末日までの期間（平成29年5月11日から平成29年7月18日まで、及び平成29年11月11日から平成30年1月15日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成29年7月18日現在	平成30年1月15日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成29年7月18日現在	平成30年1月15日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.2101円 (22,101円)	2.3840円 (23,840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	1,525,920,000	
	MCUBS MidCity投資法人	10,865	867,027,000	
	森ヒルズリート	21,092	2,963,426,000	
	産業ファンド	2,786	1,412,502,000	
	アドバンス・レジデンス	8,480	2,368,464,000	
	ケネディクスレジデンシャル	4,155	1,333,755,000	
	API投資法人	6,514	3,087,636,000	
	GLP投資法人	19,393	2,414,428,500	
	コンフォリア・レジデンシャル	6,359	1,556,683,200	
	日本プロロジスリート	15,899	3,823,709,500	
	星野リゾート・リート	1,059	597,276,000	
	ONEリート投資法人	1,770	455,244,000	
	イオンリート投資	18,019	2,209,129,400	
	ヒューリックリート投資法	10,198	1,693,887,800	
	日本リート投資法人	5,982	1,980,042,000	
	インベスコ・オフィス・Jリート	11,432	1,331,828,000	
	積水ハウス・リート投資	13,514	1,823,038,600	
	ケネディクス商業リート	7,264	1,784,764,800	
	ヘルスケア&メディカル投資	1,675	184,417,500	
	ジャパン・シニアリビング	1,142	181,692,200	
	野村不動産マスターF	40,422	5,861,190,000	
	ラサールロジポート投資	13,499	1,579,383,000	
	三井不ロジパーク	126	46,053,000	
	大江戸温泉リート	9,864	866,059,200	
	投資法人みらい	5,300	979,970,000	
	森トラスト・ホテルリート投	1,029	150,234,000	
	三菱地所物流REIT	3,726	1,023,532,200	
	日本ビルファンド	8,943	5,160,111,000	
	ジャパンリアルエステイト	13,072	7,215,744,000	
	日本リテールファンド	15,272	3,214,756,000	
	オリックス不動産投資	21,199	3,402,439,500	
	日本プライムリアルティ	4,240	1,596,360,000	
	プレミア投資法人	11,573	1,305,434,400	
	グローバル・ワン不動産投資法人	549	226,462,500	
	ユナイテッド・アーバン投資法人	16,960	2,849,280,000	
	森トラスト総合リート	9,539	1,544,364,100	
	インヴィンシブル投資法人	31,062	1,522,038,000	
	フロンティア不動産投資	3,445	1,550,250,000	
	平和不動産リート	8,480	822,560,000	
	福岡リート投資法人	7,420	1,325,212,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人	4,963	3,359,951,000	
	積水ハウス・レジデンシャル投資法人	10,445	1,205,353,000	
	いちごオフィスリート投資法人	10,840	889,964,000	
	大和証券オフィス投資法人	2,480	1,485,520,000	
	阪急リート投資法人	1,325	177,550,000	
	スターツプロシード投資法人	2,170	363,258,000	
	大和ハウスリート投資法人	9,937	2,666,097,100	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人	41,328	3,310,372,800	
	日本賃貸住宅投資法人	17,497	1,466,248,600	
	ジャパンエクセレント投資法人	12,720	1,728,648,000	
投資証券 合計			92,489,266,900	
合計			92,489,266,900	

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】

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

<訂正後>

【純資産額計算書】

平成30年1月31日

資産総額	117,705,413円
負債総額	57,546円
純資産総額（ - ）	117,647,867円
発行済数量	113,940,713口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.0325円

(参考) (F0Fs専用) ダイワS R Iファンド (適格機関投資家専用)

純資産額計算書

平成30年1月31日

資産総額	51,871,507円
負債総額	94,406円
純資産総額（ - ）	51,777,101円
発行済数量	39,356,194口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.3156円

参考情報 ダイワS R Iマザーファンド

純資産額計算書

平成30年1月31日

資産総額	814,298,178円
負債総額	24,357,060円
純資産総額（ - ）	789,941,118円
発行済数量	336,576,223口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.3470円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

純資産額計算書

平成30年1月31日

資産総額	32,244,842,485円
負債総額	44,160,442円

純資産総額(-)	32,200,682,043円
発行済数量	19,009,008,007口
1単位当たり純資産額(/)	1.6940円

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

純資産額計算書

平成30年1月31日

資産総額	107,676,897,207円
負債総額	1,138,898,077円
純資産総額(-)	106,537,999,130円
発行済数量	48,925,674,443口
1単位当たり純資産額(/)	2.1775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

平成30年1月31日

資産総額	99,377,587,006円
負債総額	1,520,241,989円
純資産総額(-)	97,857,345,017円
発行済数量	40,152,927,508口
1単位当たり純資産額(/)	2.4371円

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

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

<訂正後>

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2018年1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1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	80	207,244
追加型株式投資信託	711	15,353,435
株式投資信託 合計	791	15,560,678
単位型公社債投資信託	24	121,006
追加型公社債投資信託	14	1,645,387
公社債投資信託 合計	38	1,766,394
総合計	829	17,327,072

3 【委託会社等の経理状況】

原有価証券届出書の「第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況」を次の内容に訂正・更新します。

<訂正後>

1．当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年8月6日内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号。以下「中間財務諸表等規則」という。）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「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、第58期事業年度（平成28年4月1日から平成29年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第59期事業年度に係る中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により中間監査を受けております。

3．財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(1) 【貸借対照表】

（単位:百万円）

	前事業年度 （平成28年3月31日）	当事業年度 （平成29年3月31日）
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,715	31,260
有価証券	1,137	110
前払費用	159	190
未収委託者報酬	9,896	10,453
未収収益	87	72
繰延税金資産	468	439
その他	83	34
流動資産計	43,547	42,560
固定資産		
有形固定資産	1	229
建物	18	15
器具備品	224	214

無形固定資産	2,706	2,650
ソフトウェア	2,385	2,323
ソフトウェア仮勘定	321	327
投資その他の資産	14,223	12,353
投資有価証券	7,872	5,920
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	123	185
長期差入保証金	1,049	1,050
繰延税金資産	-	31
その他	47	37
固定資産計	17,173	15,234
資産合計	60,720	57,795

(単位:百万円)

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	61	79
未払金	8,789	9,466
未払収益分配金	5	7
未払償還金	63	59
未払手数料	4,330	4,453
その他未払金	2	4,946
未払費用	4,215	4,077
未払法人税等	1,155	980
未払消費税等	538	223
賞与引当金	937	945
その他	22	3
流動負債計	15,720	15,776
固定負債		
退職給付引当金	2,209	2,318
役員退職慰労引当金	93	151
繰延税金負債	1,410	-
その他	-	7
固定負債計	3,714	2,477
負債合計	19,435	18,254

純資産の部		
株主資本		
資本金	15,174	15,174
資本剰余金		
資本準備金	11,495	11,495
資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	13,960	12,231
利益剰余金合計	14,334	12,606
株主資本合計	41,004	39,276
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	280	264
評価・換算差額等合計	280	264
純資産合計	41,284	39,540
負債・純資産合計	60,720	57,795

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	88,850	79,747
その他営業収益	799	727
営業収益計	89,650	80,474
営業費用		
支払手数料	46,165	40,110
広告宣伝費	646	549
調査費	10,116	9,436
調査費	925	904
委託調査費	9,191	8,531
委託計算費	761	793
営業雑経費	1,346	1,375
通信費	249	251
印刷費	515	501
協会費	53	50
諸会費	14	13

その他営業雑経費	513	557
営業費用計	59,036	52,265
一般管理費		
給料	5,797	5,833
役員報酬	354	416
給料・手当	3,850	3,940
賞与	654	531
賞与引当金繰入額	937	945
福利厚生費	837	807
交際費	70	60
旅費交通費	211	178
租税公課	325	531
不動産賃借料	1,258	1,273
退職給付費用	394	463
役員退職慰労引当金繰入額	37	60
固定資産減価償却費	1,110	1,045
諸経費	1,486	1,400
一般管理費計	11,531	11,655
営業利益	19,082	16,554

(単位:百万円)

	前事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)	当事業年度 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	109	92
受取利息	25	12
投資有価証券売却益	115	224
有価証券償還益	0	94
外国税関連費用引当金戻入益	171	-
その他	72	56
営業外収益計	496	481
営業外費用		
投資有価証券売却損	14	24
その他	94	75
営業外費用計	108	100
経常利益	19,471	16,935
特別損失		
MMF等償還関連費用	-	305

特別損失計	-	305
税引前当期純利益	19,471	16,629
法人税、住民税及び事業税	6,215	6,501
法人税等調整額	6	1,405
法人税等合計	6,209	5,096
当期純利益	13,262	11,533

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当期末残高	280	280	41,284
-------	-----	-----	--------

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物 10～18年

器具備品 4～20年

(2) 無形固定資産

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

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

（表示方法の変更）

（損益計算書）

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

この結果、前事業年度の財務諸表において、「営業外収益」の「その他」に表示していた73百万円は、「有価証券償還益」0百万円、「その他」72百万円として組替えております。

（追加情報）

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

（貸借対照表関係）

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度（平成28年3月31日）

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

当事業年度（平成29年3月31日）

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

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

（単位：千株）

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

剰余金の配当の総額	11,532百万円
配当の原資	利益剰余金

1株当たり配当額	4,421円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月27日

（金融商品関係）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク

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

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

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成28年3月31日）

（単位：百万円）

	貸借対照表 計上額	時価	差額

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

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

当事業年度(平成29年3月31日)

(単位:百万円)

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

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:百万円)

区分	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)

(1) 其他有価証券 非上場株式	1,021	970
(2) 子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	5,129	5,129
(3) 長期差入保証金	1,049	1,050

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成28年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(平成29年3月31日)

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成28年3月31日)

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

当事業年度(平成29年3月31日)

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

2. 其他有価証券

前事業年度（平成28年3月31日）

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

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

当事業年度（平成29年3月31日）

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

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

3. 売却した其他有価証券

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

4. 減損処理を行った有価証券

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

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

退職給付引当金	2,209	2,318
貸借対照表に計上された負債と 資産の純額	2,209	2,318

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

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

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

	前事業年度 (平成28年3月31日)	当事業年度 (平成29年3月31日)
法定実効税率 (調整)	33.06%	法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.77%	
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	0.02%	
評価性引当額の増減額	1.29%	
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	0.19%	
その他	0.43%	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	31.89%	

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

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27年4月1日 至 平成28年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1 . 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金 (百万円)	事業の内容	議決権等の所有 (被所有) 割合 (%)	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (百万円) (注1)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	--------------------	-------	-------------------------------	---------------	-------	-----------------------	----	---------------

同一の親会社をもつ会社	大和証券(株)	東京都千代田区	100,000	金融商品取引業	-	証券投資信託受益証券の募集販売	証券投資信託の代行手数料(注2)	27,062	未払手数料	3,188
同一の親会社をもつ会社	(株)大和総研ビジネス・イノベーション	東京都江東区	3,000	情報サービス業	-	ソフトウェアの開発	ソフトウェアの購入(注3)	593	未払費用	252
同一の親会社をもつ会社	大和プロパティ(株)	東京都中央区	100	不動産管理業	-	本社ビルの管理	不動産の賃借料(注4)	1,028	長期差入保証金	1,027

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

当事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社（東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場）

（1株当たり情報）

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

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

（注2）1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）	当事業年度 （自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）
当期純利益（百万円）	13,262	11,533
普通株式の期中平均株式数（株）	2,608,525	2,608,525

（重要な後発事象）

該当事項はありません。

中間財務諸表

（1）中間貸借対照表

（単位：百万円）

当中間会計期間 （平成29年9月30日）	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	22,206
有価証券	98
未収委託者報酬	11,259
繰延税金資産	391
その他	278
流動資産合計	34,233
固定資産	
有形固定資産	1 231
無形固定資産	
ソフトウェア	2,066
その他	446
無形固定資産合計	2,512

投資その他の資産	
投資有価証券	6,874
関係会社株式	5,129
その他	1,262
投資その他の資産合計	13,266
固定資産合計	16,010
資産合計	50,244

(単位:百万円)

当中間会計期間
(平成29年9月30日)

負債の部

流動負債

未払金		7,070
未払費用		3,973
未払法人税等		916
賞与引当金		692
その他	2	606
流動負債合計		13,260

固定負債

退職給付引当金		2,324
役員退職慰労引当金		134
繰延税金負債		21
その他		6
固定負債合計		2,487

負債合計

15,747

純資産の部

株主資本

資本金		15,174
資本剰余金		
資本準備金		11,495
資本剰余金合計		11,495

利益剰余金

利益準備金		374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金		7,116

利益剰余金合計	7,490
株主資本合計	34,160
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	336
評価・換算差額等合計	336
純資産合計	34,496
負債・純資産合計	50,244

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間	
	(自 平成29年4月1日	
	至 平成29年9月30日)	
営業収益		
委託者報酬		40,996
その他営業収益		364
営業収益合計		41,360
営業費用		
支払手数料		20,216
その他営業費用		6,325
営業費用合計		26,542
一般管理費	1	5,665
営業利益		9,152
営業外収益	2	222
営業外費用		9
経常利益		9,365
特別利益		-
特別損失		-
税引前中間純利益		9,365
法人税、住民税及び事業税		2,879
法人税等調整額		69
中間純利益		6,416

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30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
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
中間純利益	-	-	-	6,416	6,416	6,416
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	-	-	-	-	-	-
当中間期変動額合計	-	-	-	5,115	5,115	5,115
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,116	7,490	34,160

	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
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	11,532
中間純利益	-	-	6,416
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	72	72	72
当中間期変動額合計	72	72	5,043
当中間期末残高	336	336	34,496

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

移動平均法による原価法により計上しております。

(2) 其他有価証券

時価のあるもの

中間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とおりであります。

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。

ただし、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、支給見込額の当中間会計期間負担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中間会計期間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事業年度ごと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中間会計期間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中間会計期間末要支給額を計上しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 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。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

	当中間会計期間 (平成29年9月30日現在)
有形固定資産	307百万円

2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。

3 保証債務

当中間会計期間（平成29年9月30日現在）

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,744百万円に対して保証を行っております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	471百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
受取配当金	49百万円
投資有価証券売却益	134百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間（自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30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	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 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

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (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

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成29年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

中間貸借対照表計上額、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)。

(単位:百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	22,206	22,206	-
(2)未収委託者報酬	11,259	11,259	-
(3)有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,002	6,002	-
資産合計	39,467	39,467	-
(1)未払金(*)	7,002	7,002	-
(2)未払費用(*)	3,424	3,424	-
負債合計	10,427	10,427	-

(*)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・預金及び(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) 未払金及び(2) 未払費用

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と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	当中間会計期間
非上場株式	970
子会社株式	5,129
差入保証金	1,044

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。

(有価証券関係)

当中間会計期間（平成29年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	124	55	69
(2) その他			
証券投資信託	4,458	3,979	479
小計	4,582	4,034	548
中間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	1,419	1,482	63
小計	1,419	1,482	63
合計	6,002	5,517	485

(注) 非上場株式（中間貸借対照表計上額 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。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

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]

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

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中間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

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が中間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中間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、中間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]

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30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]

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

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]

当中間会計期間(自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)
--

1株当たり純資産額	13,224.69円
1株当たり中間純利益金額	2,459.79円

(注1) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

(注2) 1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

当中間会計期間 (自 平成29年4月1日 至 平成29年9月30日)	
中間純利益(百万円)	6,416
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,416
普通株主に帰属しない金額(百万円)	-
普通株式の期中平均株式数(株)	2,608,525

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4 【利害関係人との取引制限】

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

<訂正後>

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第3 【その他】

<更新後>

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

<略>

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

<略>

独立監査人の監査報告書

平成30年2月16日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 貞廣 篤典 印
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 小林 英之 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）の平成29年7月19日から平成30年1月15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、『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）の平成30年1月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

大和証券投資信託委託株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

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

(注) 2 . XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成29年 5月26日

大和証券投資信託委託株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第58期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成29年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

(注) 2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[委託会社の監査報告書（当期中間）へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成29年11月22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期事業年度の中間会計期間（平成29年4月1日から平成29年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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中間監査を行った。

中間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中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間財務諸表を作成し有用な情報を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中間監査に基づいて、独立の立場から中間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中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間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に年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、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中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、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中間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、中間監査の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。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、大和証券投資信託委託株式会社の平成29年9月30日現在の財政状態並びに同日をもって終了す

る中間会計期間(平成29年4月1日から平成29年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を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. 上記は中間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データは中間監査の対象には含まれていません。