

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	平成31年4月8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 松下 浩一
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【事務連絡者氏名】	西脇 保宏 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
【電話番号】	03-5555-3431
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	『しがぎん』S R I 三資産バランス・オープン (奇数月分配型)
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	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。

第一部 【証券情報】

(1) 【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）

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託（契約型）の受益権です。

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

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

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

(3) 【発行(売出)価額の総額】

5,000億円を上限とします。

(4) 【発行(売出)価格】

1万口当たり取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

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

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

(5) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.16%（税抜2.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、2.2%となります。

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

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

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

(6) 【申込単位】

販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。

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

(7) 【申込期間】

2019年4月9日から2019年10月9日まで(継続申込期間)
(終了前に有価証券届出書を提出することにより更新されます。)

(8) 【申込取扱場所】

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

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

振替機関は下記のとおりです。
株式会社 証券保管振替機構

(12) 【その他】

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

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け付けは、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。

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

（ ）前 の申込受付中止日を除きます。

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

（ ）「分配金再投資コース」の収益分配金は、税金を差引いた後無手数料で自動的に再投資されます。ただし、販売会社によっては、収益分配金を定期的に受取るための「定期引出契約」を結ぶことができる場合があります（以下同じ。）。くわしくは、販売会社にお問合わせ下さい。

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

取得申込金額に利息は付きません。

振替受益権について

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

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

（参考）

投資信託振替制度とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

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

第二部 【ファンド情報】

第1 【ファンドの状況】

1 【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

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

商品分類	単位型投信・追加型投信	追加型投信
	投資対象地域	内外
	投資対象資産(収益の源泉)	資産複合
属性区分	投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合 資産配分固定型（株式、債券、不動産投信）））
	決算頻度	年6回（隔月）
	投資対象地域	グローバル（含む日本）
	投資形態	ファンド・オブ・ファンズ
	為替ヘッジ	為替ヘッジなし

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

(注1) 商品分類の定義

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

(注2) 属性区分の定義

- ・「その他資産」…組入れている資産
- ・「資産複合 資産配分固定型」…目論見書等において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるもの
- ・「年6回（隔月）」…目論見書等において、年6回決算する旨の記載があるもの
- ・「グローバル」…目論見書等において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるもの
- ・「ファンド・オブ・ファンズ」…「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズ
- ・「為替ヘッジなし」…目論見書等において、為替のヘッジを行なわない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行なう旨の記載がないもの

商品分類表

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

属性区分表

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

< 信託金の限度額 >

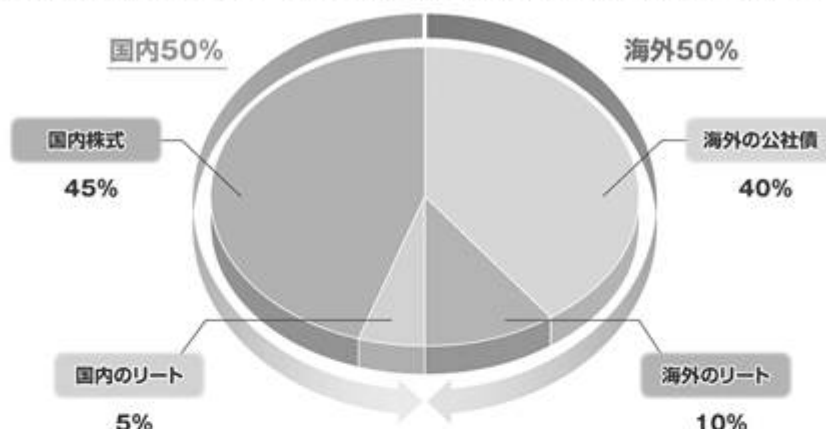
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、2,000億円を限度として信託金を追加することができます。
- ・委託会社は、受託会社と合意のうえ、限度額を変更することができます。

< ファンドの特色 >

1

国内株式、海外の公社債および内外のリートに投資します。

- 各資産の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行ないます。



※上記はイメージであり、実際の組入比率とは異なります。
 ※市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

- 当ファンドは、以下の4本の投資信託証券に投資する「ファンド・オブ・ファンズ」です。

投資対象ファンド

- ①(FOFs専用)ダイワSRIファンド(適格機関投資家専用)
- ②ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド
- ③ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド
- ④ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

ファンドの仕組み

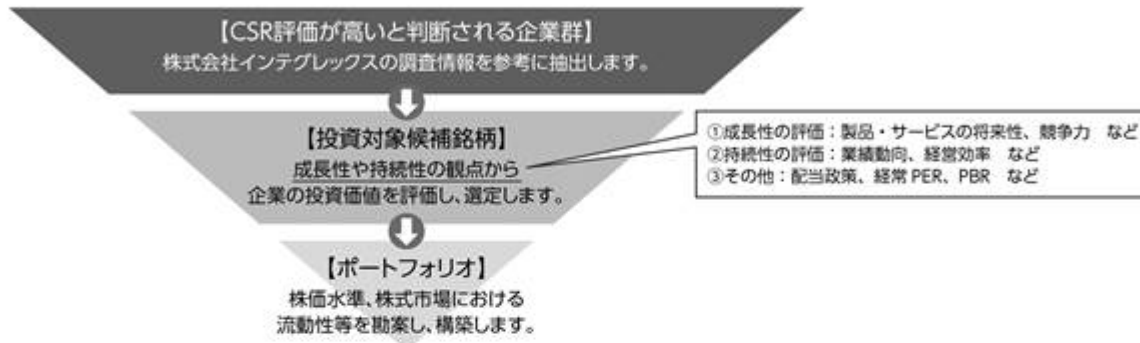
- 当ファンドは、以下の4本の投資信託証券への投資を通じて、国内株式、海外の公社債および内外のリートに投資します。



2 国内株式部分の運用にあたっては、CSR（企業の社会責任）への取り組みに着目して持続的な成長が期待される銘柄に投資します。

- CSR（Corporate Social Responsibility：企業の社会責任）に着目して投資を行なうことをSRI（Socially Responsible Investment：社会責任投資）といいます。
- ポートフォリオの構築にあたっては、企業のCSR評価と投資価値を勘案します。

ポートフォリオ構築の基本方針



- (FOFs専用) ダイブSRIファンド（適格機関投資家専用）は、TOPIX（東証株価指数）をベンチマークとして中長期的に同指数を上回る投資成果をめざします。

<ベンチマークについて>

- ・ベンチマークとは、運用成果を判断する基準となるものです。日本株全体のベンチマークとしては、市場全体の動きや構造を反映し普遍的に使用しうるものであるのが望ましいとされており、TOPIXが一般的に使用されています。
- ・ベンチマークと当ファンドの基準価額の動きを比較した結果は、交付運用報告書でお知らせします。
- ・なお、将来、ベンチマークとしてTOPIXに代わる指数を使用することが望ましいと一般的にみなされていると当社が判断した場合には、ベンチマークを当該指数に変更することがあります。
- ・当ファンドは、TOPIXとの連動をめざすものではありません。また、TOPIXを上回る運用成果を保証するものではありません。

CSRとは

□ 社会や環境に配慮し、企業のさまざまなステークホルダーとの関係を大切にすることです。

📁 ステークホルダー（利害関係者）…投資者、消費者、従業員、取引先、金融機関…など



□ CSRの評価にあたっては以下の点が着目されます。

📁 経営トップのコミットメント

- 経営理念の浸透、コーポレートガバナンス体制など

📁 企業の透明性

- 企業外への説明責任、企業内の透明性など

📁 倫理法令順守のマネジメント体制

- リスクマネジメント体制（緊急事態、海外部門、情報管理）、体制のチェック機能など

📁 企業独自の取組み

- 環境活動、社会貢献、ステークホルダー対応、IRの取組みなど

□ こうした観点から、CSRに積極的に取り組む企業が持続的に成長を続けると考えられます。

📁 株式会社 インテグレックスについて

□ 社名：株式会社インテグレックス（インテグリティ（誠実）+ X（チェック））

□ 事業内容：⇒ SRI（社会責任投資）のための金融機関への投資助言・情報提供

⇒ 投資助言・代理業（登録番号：関東財務局長（金商）第563号）

⇒ CSR（企業社会責任）の推進支援

- リスク情報受信窓口受託業務（インテグレックスホットライン）
- コンプライアンス意識調査受託業務（コンプライアンスモニタリング）
- 役員セミナー・ケーススタディ研修受託業務（インテグレックストレーニング）

□ 企業マネジメントシステムの定量評価会社。2001年6月設立。環境対策や社会貢献だけでなく、企業の経営体制までも考慮した評価基準に基づき調査を行なう。

⇒ 麗澤大学企業倫理研究センターを中心に作成された規格に基づく社会責任投資基準（R-BEC001）によりSRI評価を行なう。

⇒ 代表取締役社長：秋山 をね

□ 金融機関、事業会社と資本関係を持たない中立的な調査会社。

⇒ 金融機関、事業会社からの中立・公正を保つため、出資者はすべて個人。

□ 調査対象は全上場企業。

⇒ 2001年度よりアンケート調査を実施。

⇒ 回答企業を中心に評価を行なう（2018年3月末 評価企業数680社）。

📁 用語について

R-BEC001（社会責任投資基準）

⇒ 企業の「倫理やコンプライアンス（倫理法令順守）」への取組みを調査するための評価基準。

⇒ 「企業の誠実さ（インテグリティ）」を測ること、組織としての自律能力を見ることが、またそれを担保するための内部管理体制をチェックすることが特徴。

⇒ 倫理法令順守マネジメント・システム規格のECS2000をもとに作成されている。

ECS2000（倫理法令順守マネジメント・システム規格）

⇒ 倫理・法令順守の状況ではなく、法令を順守し、倫理の実践を推進するための企業の仕組みに関する国内規格。PDCAサイクル（Plan-Do-Check-Act）に着目しています。

⇒ 海外の企業倫理規格には、SA8000（米国）、AA1000（英国）等があります。

3

海外の公社債への投資にあたっては、ソブリン債等に投資します。

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

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

ポートフォリオのイメージ

ドル通貨圏：50%程度 欧州通貨圏：50%程度



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

※東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等

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

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

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

債券の格付けについて



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

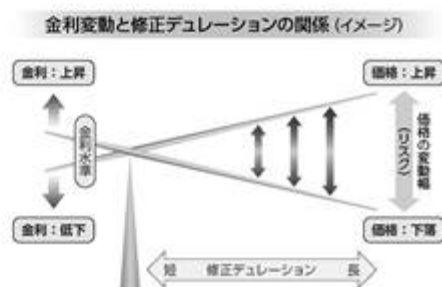
※1 ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上

※2 ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上

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

修正デュレーションについて

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



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

4

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

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

ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにおける外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。

投資対象銘柄の業種 (イメージ)



投資対象地域 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

〈コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクについて〉

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

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

投資対象銘柄の業種 (イメージ)



※上記はイメージであり、実際に投資するとは限りません。

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

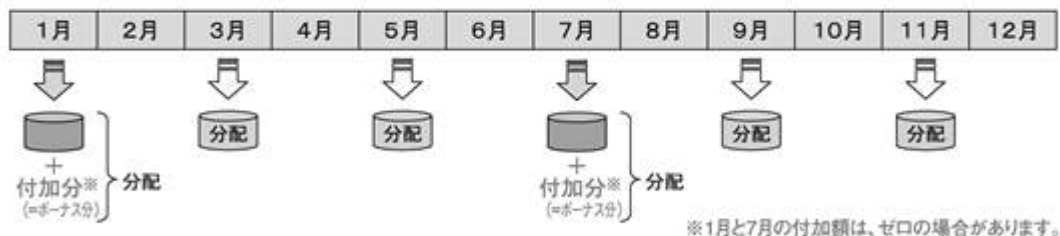
・大量の追加設定または解約が発生したとき、市況の急激な変化が予想されるとき、償還の準備に入ったとき等ならびに信託財産の規模によっては、ファンドの特色1.～4.の運用が行なわれないことがあります。

5 毎年1、3、5、7、9、11月の各15日（休業日の場合翌営業日）に決算を行ない、収益分配方針に基づいて収益の分配を行ないます。

〈分配方針〉

- ①分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。
- ②原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。1月と7月の計算期末については、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮し、分配対象額の中から基準価額水準に応じて委託会社が決定する額を、上記継続分配相当額に付加して分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。

収益分配のイメージ



- ◆上記はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。
- ◆分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。分配金が支払われない場合もあります。
- ◆毎年1月および7月の計算期末にかかる分配金額について、基準価額の水準、分配対象額の状態等によっては、それ以外の月と同程度または下回る金額となる場合があります。
- ◆ファンドの基準価額は変動します。投資元本、利回りが保証されているものではありません。

投資対象ファンドの概要

I. (FOFs 専用) ダイワSRIファンド（適格機関投資家専用）

基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
投資態度	<p>①主としてダイワSRIマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券に投資することにより、わが国の金融商品取引所上場株式の中からCSR(企業の社会責任)への取組みに着目して持続的な成長が期待される銘柄に実質的に投資し、信託財産の成長をめざします。</p> <p>②ポートフォリオの構築にあたっては、企業のCSR評価と投資価値を勘案し、以下の方針で行なうことを基本とします。</p> <p>イ. ㈱インテグレックスの調査情報を参考に、CSR評価が高いと判断される企業群を抽出します。</p> <p>ロ. 上記企業群の中から、成長性や持続性の観点から企業の投資価値を評価し、投資対象候補銘柄を選びます。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・成長性の評価：製品・サービスの将来性、競争力 など ・持続性の評価：業績動向、経営効率 など ・その他：配当政策、経常PER、PBR など <p>ハ. 株価水準、株式市場における流動性等を勘案し、ポートフォリオを構築します。</p> <p>③TOPIX(東証株価指数)をベンチマークとして中長期的に同指数を上回る投資成果をめざします。</p> <p>④マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の90%程度以上とすることを基本とします。</p> <p>⑤株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資は、原則として、信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>⑥当ファンドは、ファンド・オブ・ファンズのみを取得させることを目的とするものです。</p>
ダイワSRIマザーファンドの投資態度	<p>①わが国の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)株式および店頭登録(登録予定を含みます。)株式を主要投資対象とし、CSR(企業の社会責任)への取組みに着目して、持続的な成長が期待される銘柄に投資することにより、信託財産の成長をめざします。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・当ファンドのように、CSR(Corporate Social Responsibility: 企業の社会責任)に着目して投資を行なうことをSRI(Socially Responsible Investment: 社会責任投資)といいます。 <p>②～③（上記「投資態度」の②～③と同規定）</p> <p>④株式の実質組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の90%程度以上とすることを基本とします。</p>
信託期間	無期限（2006年9月28日当初設定）
決算日	毎年5月19日および11月19日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用（信託報酬）	信託財産の純資産総額に対して年率0.8295%（税抜0.79%）
信託事務の諸費用および監査報酬	<p>①信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息および信託財産にかかる監査報酬ならびに当該監査報酬にかかる消費税等に相当する金額は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。</p> <p>②信託財産に属する有価証券等に関連して発生した訴訟係争物たる権利その他の権利に基づいて益金が生じた場合、当該支払いに際して特別に必要となる費用(データ処理費用、郵送料等)は、受益者の負担とし、当該益金から支弁します。</p>
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社
受託会社	三菱UFJ信託銀行株式会社(再信託受託会社:日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

Ⅱ. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

基本方針	安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
投資態度等	<p>①主として海外のソブリン債等(国債、政府機関債、中央政府により発行・保証された債券、国際機関債など)に投資することにより、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。</p> <p>②海外のソブリン債等への投資にあたっては、以下のような点に留意しながら運用を行なうことを基本とします。</p> <p>イ. 米ドル、カナダ・ドルおよびオーストラリア・ドル等をドル通貨圏、ユーロ、ポンド、北欧通貨および東欧通貨等を欧州通貨圏とし、2通貨圏への投資割合をそれぞれ信託財産の純資産総額の50%程度ずつとすることを基本とします。</p> <p>※ 北欧通貨：スウェーデン・クローネ、デンマーク・クローネ、ノルウェー・クローネ</p> <p>※ 東欧通貨：ハンガリー・フォリント、ポーランド・ズロチ、チェコ・コルナ等</p> <p>ロ. ドル通貨圏内では米ドルへの投資割合を50%程度、欧州通貨圏内ではユーロへの投資割合を50%程度とすることを基本とします(ただし、欧州通貨圏の投資対象通貨がユーロに統合される場合は、統合される通貨で実際に投資されている比率をユーロで実際に投資されている比率に加算した比率に基づいて、配分比率を見直します。)</p> <p>ハ. 国債については、取得時においてA格相当以上(ムーディーズでA3以上またはS&PでA-以上)とすることを基本とします。国債を除く投資対象の格付けは、取得時においてAA格相当以上(ムーディーズでAa3以上またはS&PでAA-以上)とすることを基本とします。</p> <p>ニ. 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。</p> <p>ホ. 金利リスク調整のため、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建の国債先物取引等を利用することがあります。</p> <p>③為替については、ドル通貨圏と欧州通貨圏の通貨建資産の投資比率合計を、信託財産の純資産総額の100%に近づけることを基本とします。</p>
信託期間	無期限(2005年4月26日当初設定)
決算日	毎年4月10日および10月10日(休業日の場合翌営業日)
運用管理費用(信託報酬)	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社(再信託受託会社:日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社)

Ⅲ. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

基本方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
投資態度等	①海外の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)および店頭登録(登録予定を含みます。)の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、安定的な配当利回りの確保と信託財産の中長期的な成長をめざして分散投資を行ないます。 ②投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。 イ、個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。 ロ、組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。 ③外貨建資産の運用にあたっては、コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インクに運用の指図にかかる権限を委託します。 ④不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。 ⑤外貨建資産の為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行ないません。
信託期間	無期限（2005年6月24日当初設定）
決算日	毎年3月15日および9月15日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用（信託報酬）	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社（再信託受託会社:日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

Ⅳ. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

基本方針	信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。
投資態度	①わが国の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)の不動産投資信託証券を主要投資対象とし、配当等収益の確保と信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行ないます。 ②投資にあたっては、以下の方針に従って行なうことを基本とします。 イ、個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。 ロ、個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。 ③不動産投資信託証券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。
信託期間	無期限（2005年11月14日当初設定）
決算日	毎年5月10日および11月10日（休業日の場合翌営業日）
運用管理費用（信託報酬）	かかりません。
信託事務の諸費用	信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社
受託会社	三井住友信託銀行株式会社（再信託受託会社:日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社）

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

【収益分配金に関する留意事項】

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

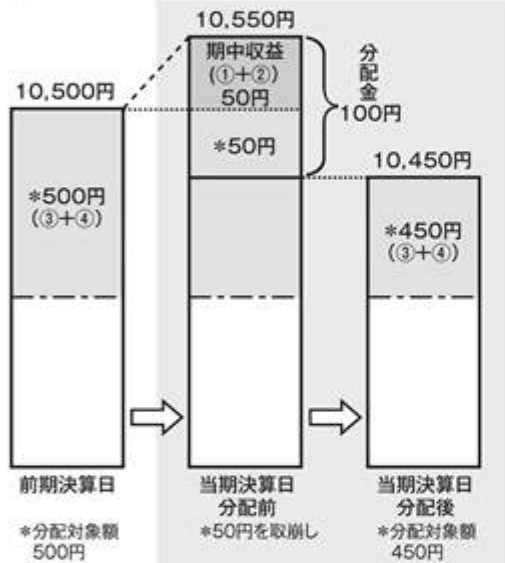
投資信託で分配金が支払われるイメージ



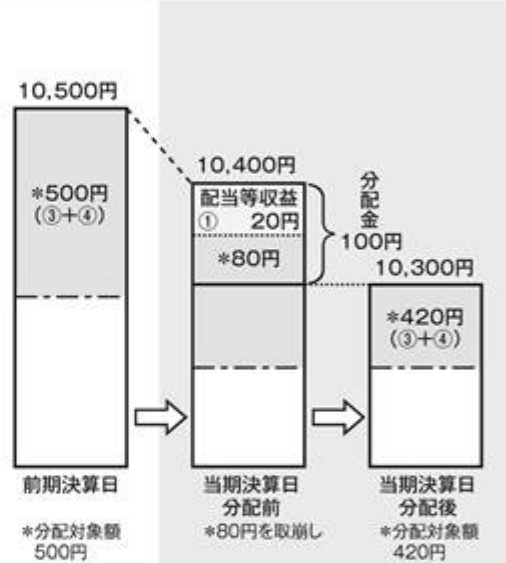
- 分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

(計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合)

(前期決算日から基準価額が上昇した場合)



(前期決算日から基準価額が下落した場合)

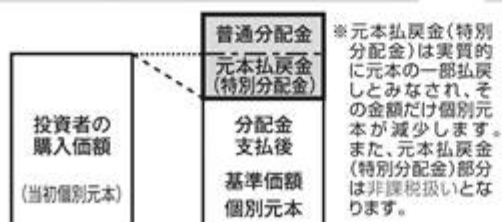


(注) 分配対象額は、①経費控除後の配当等収益および②経費控除後の評価益を含む売買益ならびに③分配準備積立金および④収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

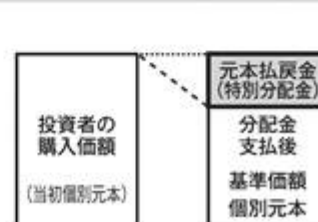
※上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありませんのでご留意下さい。

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

(分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合)



(分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合)



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

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

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

(2) 【ファンドの沿革】

2006年9月27日

信託契約締結、当初設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

受益者

お申込者

収益分配金(注1)、償還金など お申込金(5)

お取扱窓口	販売会社	<p>受益権の募集・販売の取扱い等に関する委託会社との契約（ 1 ）に基づき、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集の取扱い 一部解約請求に関する事務 収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務 など</p>
1	収益分配金、償還金など お申込金（ 5 ）	
委託会社	大和証券投資信託委託株式会社	<p>当ファンドにかかる証券投資信託契約（以下「信託契約」といいます。）（ 2 ）の委託者であり、次の業務を行ないます。</p> <p>受益権の募集・発行 信託財産の運用指図 信託財産の計算 運用報告書の作成 など</p>
運用指図	2	損益 信託金（ 5 ）
受託会社	<p>三井住友信託銀行株式会社</p> <p>再信託受託会社： 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社</p>	<p>信託契約（ 2 ）の受託者であり、次の業務を行ないます。なお、信託事務の一部につき日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することができます。また、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。</p> <p>委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分 信託財産の計算 など</p>
		損益 投資
投資対象	<p>投資対象ファンドの受益証券（振替受益権を含みます。） など</p> <p>（「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」における外貨建資産の運用にあたっては、投資顧問会社（コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク）（注2）に運用の指図にかかる権限を委託します。</p>	

（注1）「分配金再投資コース」の場合、収益分配金は自動的に再投資されます。

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

- 1：受益権の募集の取扱い、一部解約請求に関する事務、収益分配金、償還金、一部解約金の支払いに関する事務の内容等が規定されています。
- 2：「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づいて、あらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容に基づき締結されます。証券投資信託の運営に関する事項（運用方針、委託会社および受託会社の業務、受益者の権利、信託報酬、信託期間等）が規定されています。
- 3：運用指図権限委託の内容およびこれにかかる事務の内容、投資顧問会社が受ける報酬等が定められています。
- 4：投資顧問会社が法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生ぜしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。

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

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

ファンドの仕組み

●当ファンドは、以下の4本の投資信託証券への投資を通じて、国内株式、海外の公社債および内外のリートに投資します。



< 委託会社の概況（2019年1月末日現在） >

・資本金の額 151億7,427万2,500円

・沿革

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

・大株主の状況

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

2 【投資方針】

(1) 【投資方針】

主要投資対象

下記の1.から4.までに掲げるファンドの受益証券（以下総称して「指定投資信託証券」といいます。受益証券は振替受益権を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします（2.から4.までに掲げるファンドを、以下総称して「マザーファンド」といいます。）。

- 1.（F0Fs専用）ダイワS R Iファンド（適格機関投資家専用）の受益証券
- 2.ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券
- 3.ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンドの受益証券
- 4.ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンドの受益証券

投資態度

イ.主として複数の投資信託証券を通じて、国内株式、海外の公社債、および内外の不動産投資信託証券に投資し、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざします。

ロ.各投資信託証券の組入比率については、下記の標準組入比率を目処に投資を行いません。ただし、市場規模等によっては、組入比率を変更することがあります。

（F0Fs専用）ダイワS R Iファンド（適格機関投資家専用）の受益証券

.....信託財産の純資産総額の45%

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券.....信託財産の純資産総額の40%

ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンドの受益証券

.....信託財産の純資産総額の10%

ダイワJ - R E I Tアクティブ・マザーファンドの受益証券

.....信託財産の純資産総額の5%

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

ニ.株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）

への投資は、原則として、信託財産総額の75%以下とします。

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

<投資先ファンドについて>

投資先ファンドの選定の方針は次のとおりです。

投資先ファンド	（F0Fs専用）ダイワS R Iファンド（適格機関投資家専用）
選定の方針	わが国の株式を主要投資対象とし、C S R（企業の社会責任）への取組みに着目して持続的な成長が期待される銘柄に実質的に投資しているファンドであること。

投資先ファンド	海外の金融商品取引所（ ）上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託証券（「ダイワ・グローバルR E I T・マザーファンド」を通じて実質的に投資します。）
---------	--

選定の方針	(a) 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。 (b) 組入れる銘柄の業種および国・地域配分の分散を考慮します。
-------	---

金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。

投資先ファンド	わが国の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。以下同じ。)の不動産投資信託証券 (「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド)を通じて実質的に投資します。)
選定の方針	(a) 個別銘柄の投資価値を分析して、銘柄ごとの配当利回り、期待される成長性、相対的な割安度などを勘案し投資銘柄を選定します。 (b) 個別銘柄の組入不動産の種類等を考慮します。

くわしくは「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格<ファンドの特色>」をご参照下さい。

(2) 【投資対象】

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ. 有価証券

ロ. 約束手形

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

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ. 為替手形

委託会社は、信託金を、次の1.から4.までに掲げる証券投資信託の受益証券(以下総称して「指定投資信託証券」といいます。受益証券は振替受益権を含みます。以下同じ。)、ならびに次の5.および6.に掲げる有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図することができます(次の2.から4.までに掲げる親投資信託を、以下総称して「マザーファンド」といいます。)

1. (FOFs専用)ダイワSRIファンド(適格機関投資家専用)の受益証券

2. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンドの受益証券

3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドの受益証券

4. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンドの受益証券

5. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

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

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

<投資先ファンドについて>

ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性がある投資先ファンドの内容は次のとおりです。

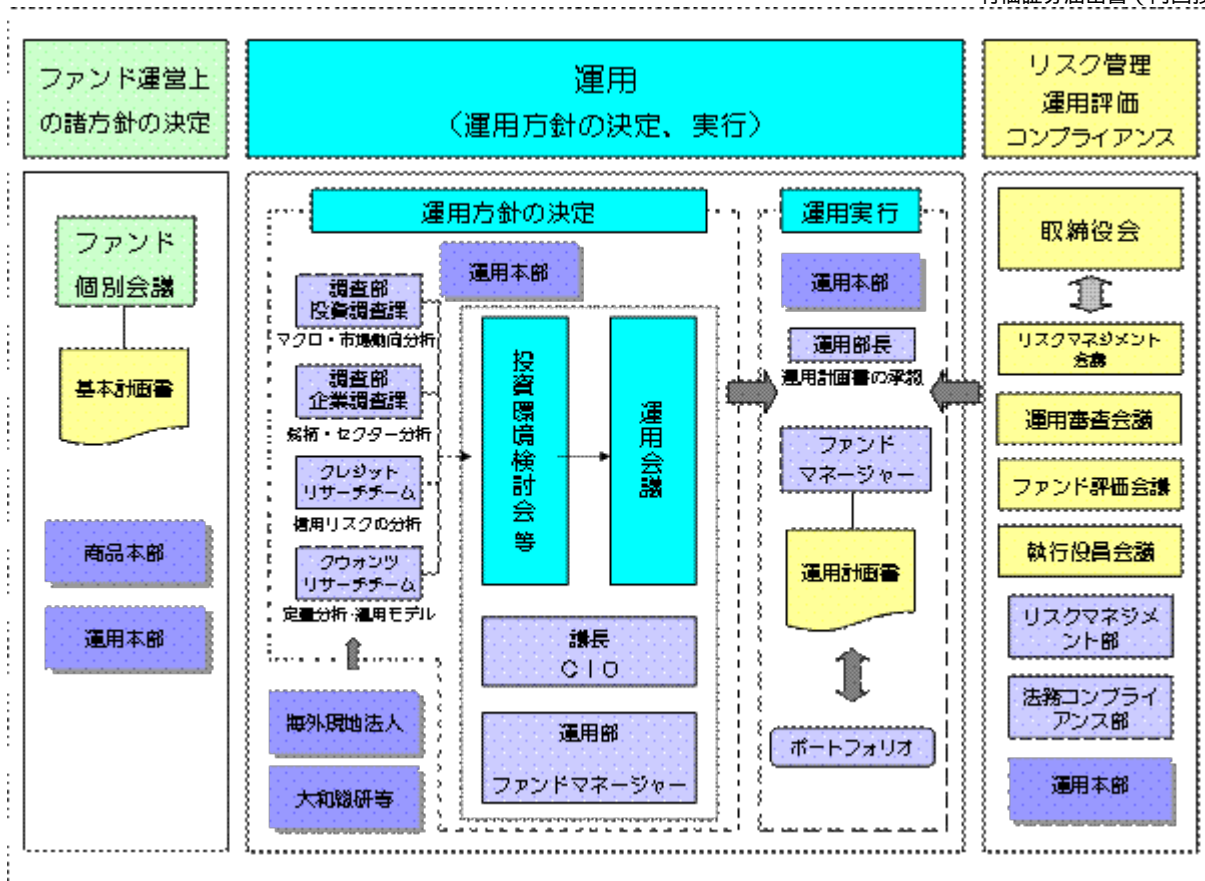
投資先ファンドの名称	（F0Fs専用）ダイワS R Iファンド（適格機関投資家専用）
運用の基本方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要な投資対象	ダイワS R Iマザーファンドを通じて、わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の株式に投資します。
委託会社の名称	大和証券投資信託委託株式会社

くわしくは「1 ファンドの性格（1）ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

(3) 【運用体制】

運用体制

ファンドの運用体制は、以下のとおりとなっています。



運用方針の決定にかかる過程

運用方針は次の過程を経て決定しております。

イ．基本計画書の策定

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

ロ．投資環境の検討

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

ハ．基本的な運用方針の決定

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

ニ．運用計画書の作成・承認

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

職務権限

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

イ．CIO（Chief Investment Officer）（1名）

運用最高責任者として、次の職務を遂行します。

- ・ファンド運用に関する組織運営
- ・ファンドマネージャーの任命・変更

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

ロ．Deputy-CIO（0～5名程度）

CIOを補佐し、その指揮を受け、職務を遂行します。

ハ．インベストメント・オフィサー（0～5名程度）

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

ニ．運用部長（各運用部に1名）

ファンドマネージャーが策定する運用計画を承認します。

ホ．ファンドマネージャー

ファンドの運用計画を策定して、これに沿ってポートフォリオを構築します。

ファンド評価会議、運用審査会議、リスクマネジメント会議および執行役員会議

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

イ．ファンド評価会議

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

ロ．運用審査会議

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

ハ．リスクマネジメント会議

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

ニ．執行役員会議

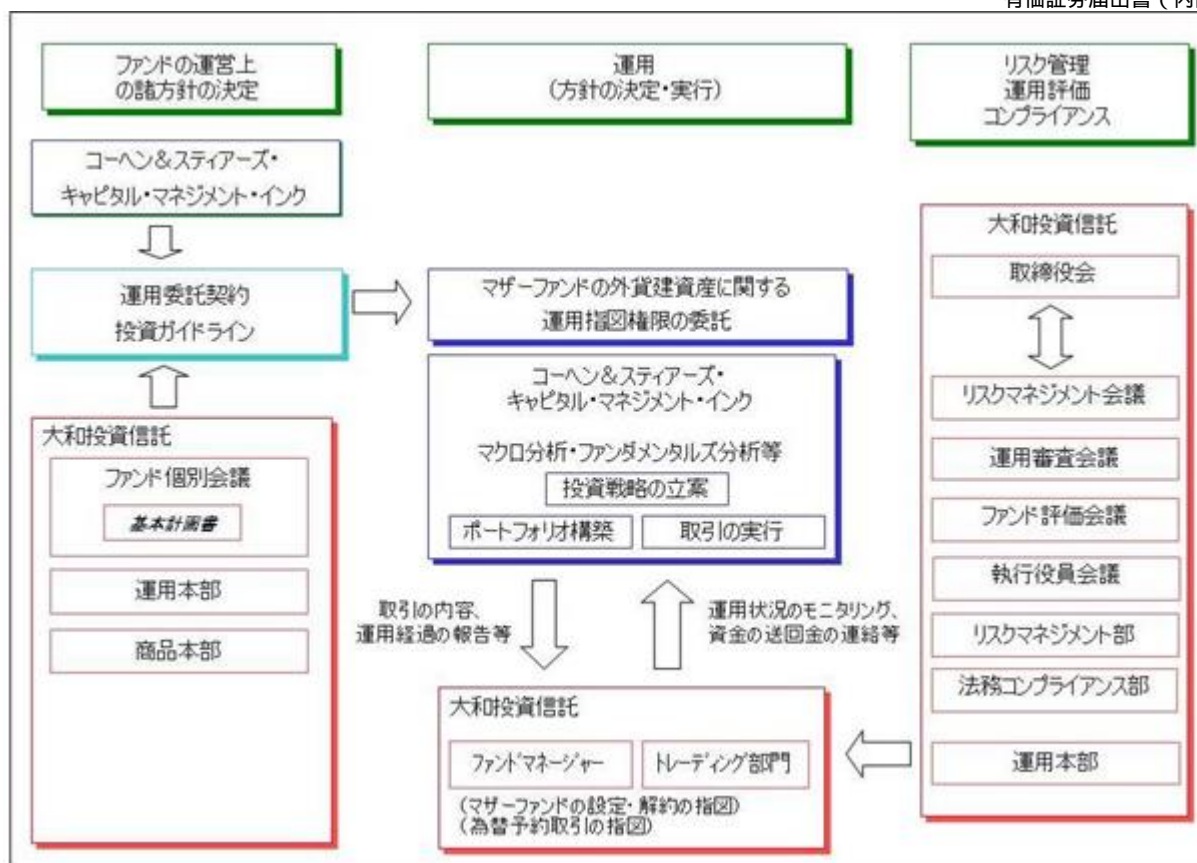
経営会議の分科会として、法令等の遵守状況についての報告を行ない、必要事項を審議・決定します。

受託会社に対する管理体制

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

海外リート部分にかかる運用体制について

（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドにかかるものを含みます。）



イ．ファンド運営上の諸方針の決定

ファンド運営上の諸方針を記載した基本計画書を経営会議の分科会であるファンド個別会議において審議・決定します。なお、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」では、投資顧問会社に外貨建資産の運用の指図にかかる権限を委託します。このため、当該投資顧問会社と委託会社の間で締結する運用委託契約に基づく投資ガイドラインに、このファンド運営上の諸方針が反映されます。

ロ．運用の実行

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

ハ．モニタリング

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

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

ニ．リスク管理、運用評価、コンプライアンス

（前 に同じ。）

上記の運用体制は2019年1月末日現在のものであり、変更となる場合があります。

(4) 【分配方針】

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

原則として、安定した分配を継続的に行なうことをめざします。2007年1月を除く各1、7月の計算期末については、今後の安定分配を継続するための分配原資の水準を考慮し、分配対象額の中から基準価額水準に応じて委託会社が決定する額を、上記継続分配相当額に付加して分配する場合があります。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。また、第1計算期末には、収益の分配は行ないません。

留保益は、前(1)に基づいて運用します。

(5) 【投資制限】

株式（信託約款）

株式への直接投資は、行ないません。

投資信託証券（信託約款）

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。

同一銘柄の投資信託証券（信託約款）

イ．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券の時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超えることとなる投資の指図をしません。

ロ．前イ．にかかわらず、委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の投資信託証券で、その約款または規約においてファンド・オブ・ファンズにのみ取得されることが定められているものの時価総額が、信託財産の純資産総額の100分の50を超える投資の指図をすることができるものとしします。

ハ．委託会社は、指定投資信託証券に属する同一銘柄の不動産投資信託の受益証券または同一銘柄の不動産投資法人の投資証券（以下総称して「不動産投資信託証券」といいます。）の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。

外貨建資産（信託約款）

イ．外貨建資産への直接投資は、行ないません。

ロ．委託会社は、マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額が、信託財産総額の100分の75を超えることとなる投資の指図をしません。ただし、有価証券の値上がり等により100分の75を超えることとなった場合には、すみやかにこれを調整します。

ハ．前ロ．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（信託約款）

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

外国為替予約取引（信託約款）

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

資金の借入れ（信託約款）

- イ．委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
- ロ．一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間、または解約代金の入金日までの間、もしくは償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- ハ．収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ニ．借入金の利息は信託財産中から支弁します。

<参考> 投資対象ファンドについて

下記以外の項目（「基本方針」、「投資態度」、「運用管理費用（信託報酬）」等）については、「1 ファンドの性格 (1) ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。

1. (F0Fs専用) ダイワSRIFファンド(適格機関投資家専用)

主な投資制限	マザーファンドの受益証券への投資割合には、制限を設けません。 株式への実質投資割合には、制限を設けません。 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 外貨建資産への投資は、行ないません。
収益分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とします。 原則として、基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。 留保益は、「基本方針」および「運用方法」に基づいて運用します。
販売手数料	ありません。
償還条項	受益権の口数が30億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

2. ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限りません。</p> <p>株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。</p> <p>投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>
収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。
償還条項	信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

3. ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

主な投資制限	<p>株式への直接投資は、行ないません。</p> <p>投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の不動産投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。</p>
運用指図 権限の委託	<p>委託会社は、運用の指図に関する権限のうち、外貨建資産の運用に関する権限を次のものに委託します。</p> <p>コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク New York, New York, USA</p> <p>前 の規定にかかわらず、前 により委託を受けた者が、法律に違反した場合、信託契約に違反した場合、信託財産に重大な損失を生じしめた場合等において、委託会社は、運用の指図に関する権限の委託を中止または委託の内容を変更することができます。</p>
収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。
償還条項	信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

4. ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

主な投資制限	<p>～（ダイワ・グローバルREIT・マザーファンドと同規定）</p> <p>外貨建資産への直接投資は、行ないません。</p>
収益分配方針	信託財産から生ずる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配は行ないません。
販売手数料	ありません。
償還条項	信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。

3 【投資リスク】

(1) 価額変動リスク

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

投資信託は預貯金とは異なります。

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

基準価額の主な変動要因については、次のとおりです。

株価の変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

公社債の価格変動（価格変動リスク・信用リスク）

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

リート（不動産投資信託）への投資に伴うリスク

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

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

ロ．リートの価格や配当は、リートの収益や財務内容の変動の影響を受けます。

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

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

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

外国証券への投資に伴うリスク

イ．為替リスク

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

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

ロ．カントリー・リスク

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

その他

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

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

(2) 換金性が制限される場合

通常と異なる状況において、ご換金に制限を設けることがあります。

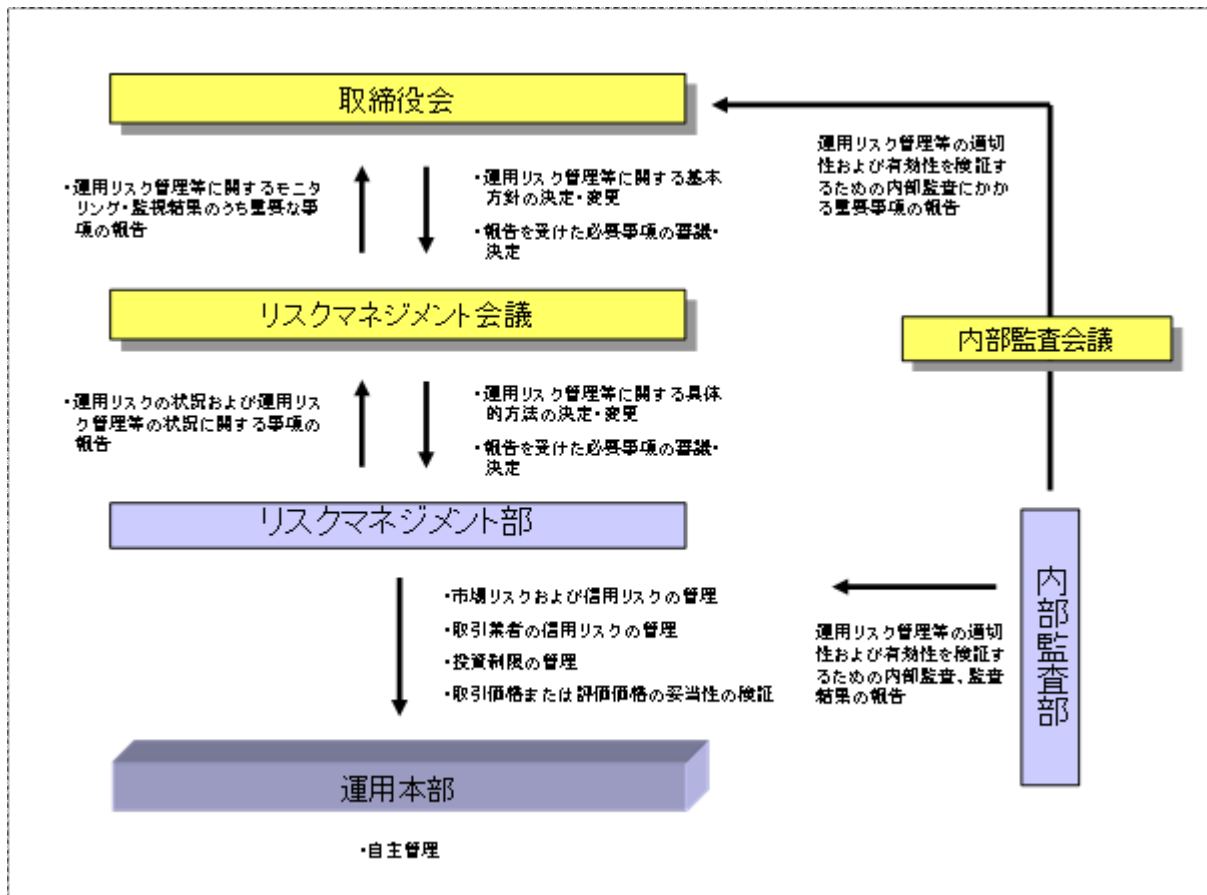
金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、ご換金の申込みの受け付けを中止することがあります。ご換金の申込みの受け付けが中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日のご換金の申込みを撤回できます。ただし、受益者がそのご換金の申込みを撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にご換金の申込みを受け付けたものとして取扱います。

(3) その他の留意点

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

(4) リスク管理体制

運用リスク管理体制（ ）は、以下のとおりとなっています。

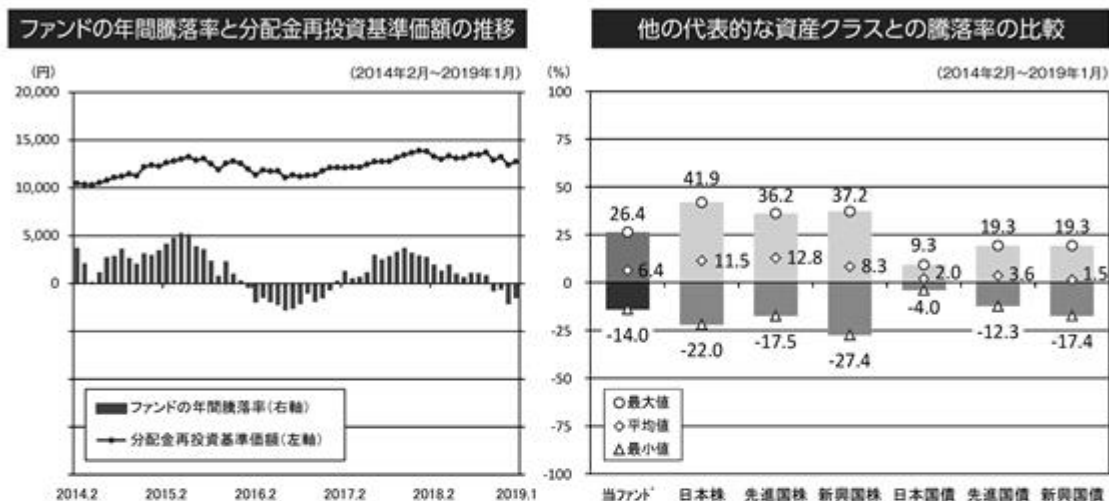


流動性リスクに対する管理体制

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

参 考 情 報

- 下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。右のグラフは過去5年間に於ける年間騰落率（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、知的財産権その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。またMSCI Inc.は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。●NOMURA-BPI国債は、野村證券株式会社が公表する国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI国債の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、完全性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。●FTSE世界国債インデックスは、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。●JPモルガン ガバメント・ボンド・インデックスー エマージング・マーケット グローバル ダイバーシファイドは、信頼性が高いとみなす情報に基づき作成していますが、J.P. Morganはその完全性・正確性を保証するものではありません。本指数は許諾を受けて使用しています。J.P. Morganからの書面による事前承認なしに本指数を複製・使用・頒布することは認められていません。Copyright 2016, J.P. Morgan Chase & Co. All rights reserved.

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

販売会社におけるお買付時の申込手数料の料率の上限は、2.16%（税抜2.0%）となっています。具体的な手数料の料率等については、販売会社または委託会社にお問合わせ下さい。消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、2.2%となります。

- ・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

申込手数料には、消費税等が課されます。

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

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

(2) 【換金(解約)手数料】

換金手数料

ありません。

信託財産留保額

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年率1.08%（税抜1.0%）を乗じて得た額とします。信託報酬は、毎日計上され、毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、1.1%となります。

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

信託報酬にかかる委託会社、販売会社、受託会社への配分については、次のとおりです。

	委託会社	販売会社 （各販売会社の取扱 純資産総額 に応じて）	受託会社
100億円以下の部分	総額から販売会社 および受託会社へ の配分を除いた額	年率0.65% （税抜）	年率0.05% （税抜）
100億円超200億円以下の部分		年率0.70% （税抜）	
200億円超500億円以下の部分		年率0.75% （税抜）	
500億円超の部分		年率0.80% （税抜）	

上記の信託報酬の配分には、別途消費税率を乗じた額がかかります。

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

委託会社は、「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の投資顧問会社が受ける報酬を、次のとおり支払うものとし、その額は当該マザーファンドの日々の純資産総額に次の率を乗じて得た額とします。報酬の支払いは、毎年3月15日および9月15日または信託終了のときに行なうものとします。

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

投資対象ファンドの信託報酬等については、「1 ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格 <ファンドの特色>」をご参照下さい。なお、当ファンドの信託報酬に投資対象ファンドの信託報酬を加えた、投資者が実質的に負担する信託報酬率は、年率1.46394%（税抜1.3555%）程度です（当ファンドにおける実際の投資信託証券の組入状況により変動します。）。

消費税率が8%の場合の率です。消費税率が10%の場合は、1.49105%となります。

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

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

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

受託会社：運用財産の管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

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

<投資対象ファンドより支弁する手数料等>

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は株式投資信託として取扱われます。

個人の投資者に対する課税

イ．収益分配金に対する課税

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

ロ．解約金および償還金に対する課税

一部解約時および償還時の差益（解約価額および償還価額から取得費用（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20%（所得税15%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。ただし、2037年12月31日まで基準所得税額に2.1%の税率を乗じた復興特別所得税が課され、税率は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。

ハ．損益通算について

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

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

少額投資非課税制度「愛称：N I S A（ニーサ）」をご利用の場合

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

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

法人の投資者に対する課税

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

源泉徴収された税金は法人税額から控除されます。

<注1> 個別元本について

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

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

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

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

<注2> 収益分配金の課税について

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

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

（ ）上記は、2019年1月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

（ ）課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5 【運用状況】

(1) 【投資状況】（2019年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	45,814,486	46.28
内 日本	45,814,486	46.28
親投資信託受益証券	52,203,376	52.74
内 日本	52,203,376	52.74
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	973,923	0.98
純資産総額	98,991,785	100.00

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

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

(2) 【投資資産】（2019年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	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1 ダイワSRIファンド	日本	投資信託受益証券	40,946,006	1.0939 44,790,835	1.1189 45,814,486	46.28
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	22,436,633	1.6371 36,731,011	1.6588 37,217,886	37.60
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	4,310,926	2.2156 9,551,287	2.3673 10,205,255	10.31
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	1,772,953	2.5927 4,596,735	2.6962 4,780,235	4.83

(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	46.28%
親投資信託受益証券	52.74%

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。

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額 (分配落) (円)	純資産総額 (分配付) (円)	1口当たりの 純資産額 (分配落)(円)	1口当たりの 純資産額 (分配付)(円)
第6特定期間末 (2009年7月15日)	527,342,643	529,907,249	0.6169	0.6199
第7特定期間末 (2010年1月15日)	495,920,918	498,107,255	0.6805	0.6835
第8特定期間末 (2010年7月15日)	423,499,174	425,518,422	0.6292	0.6322
第9特定期間末 (2011年1月17日)	375,000,976	376,719,030	0.6548	0.6578
第10特定期間末 (2011年7月15日)	324,615,470	326,154,768	0.6327	0.6357
第11特定期間末 (2012年1月16日)	242,704,479	243,992,397	0.5653	0.5683
第12特定期間末 (2012年7月17日)	220,887,840	222,008,968	0.5911	0.5941
第13特定期間末 (2013年1月15日)	229,696,095	230,686,324	0.6959	0.6989
第14特定期間末 (2013年7月16日)	253,074,244	254,009,452	0.8118	0.8148

第15特定期間末 (2014年1月15日)	229,419,669	230,221,803	0.8580	0.8610
第16特定期間末 (2014年7月15日)	219,048,037	219,807,672	0.8651	0.8681
第17特定期間末 (2015年1月15日)	190,367,012	190,965,134	0.9548	0.9578
第18特定期間末 (2015年7月15日)	160,666,940	161,143,900	1.0106	1.0136
第19特定期間末 (2016年1月15日)	137,131,073	137,582,463	0.9114	0.9144
第20特定期間末 (2016年7月15日)	126,011,752	126,443,178	0.8762	0.8792
第21特定期間末 (2017年1月16日)	130,573,394	130,999,402	0.9195	0.9225
第22特定期間末 (2017年7月18日)	124,436,479	124,695,330	0.9615	0.9635
第23特定期間末 (2018年1月15日)	121,716,054	121,948,212	1.0486	1.0506
2018年1月末日	117,647,867	-	1.0325	-
2月末日	111,795,166	-	0.9926	-
3月末日	108,768,067	-	0.9691	-
4月末日	109,671,792	-	0.9941	-
5月末日	106,589,458	-	0.9745	-
6月末日	106,090,345	-	0.9789	-
第24特定期間末 (2018年7月17日)	106,105,502	106,318,089	0.9982	1.0002
7月末日	106,429,927	-	1.0008	-
8月末日	106,365,734	-	1.0002	-
9月末日	107,815,201	-	1.0168	-
10月末日	100,849,532	-	0.9565	-
11月末日	103,137,533	-	0.9802	-
12月末日	96,445,370	-	0.9166	-
第25特定期間末 (2019年1月15日)	96,640,716	96,851,147	0.9185	0.9205
2019年1月末日	98,991,785	-	0.9404	-

【分配の推移】

	1口当たり分配金(円)
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
第24特定期間	0.0060
第25特定期間	0.0060

(注) 1口当たり分配金は外国税額控除前のものです。

【収益率の推移】

	収益率(%)
第6特定期間	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
第24特定期間	4.2
第25特定期間	7.4

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定数量(口)	解約数量(口)
第6特定期間	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
第24特定期間	156,896	9,942,463
第25特定期間	154,413	1,232,073

(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 (2019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	46,276,828	99.50
内 日本	46,276,828	99.50
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)	232,343	0.50

純資産総額	46,509,171	100.00
-------	------------	--------

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

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

(2) 投資資産 (2019年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	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	ダイワSRIマザーファンド	日本	親投資 信託受 益証券	22,646,975	2.1276 48,184,082	2.0434 46,276,828	99.50

(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
親投資信託受益証券	99.50%
合計	99.50%

(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

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 (2019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	670,020,750	95.63

	内 日本	670,020,750	95.63
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		30,634,762	4.37
純資産総額		700,655,512	100.00

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

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

(2) 投資資産 (2019年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	業種	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	小松製作所	日本	株式	機械	11,000	3,693.35 40,626,941	2,761.50 30,376,500	4.34
2	信越化学	日本	株式	化学	3,000	11,365.47 34,096,438	9,176.00 27,528,000	3.93
3	伊藤忠テクノソリューションズ	日本	株式	情報・通信業	11,800	2,068.20 24,404,844	2,262.00 26,691,600	3.81
4	村田製作所	日本	株式	電気機器	1,700	16,135.70 27,430,694	15,420.00 26,214,000	3.74
5	三菱商事	日本	株式	卸売業	8,100	3,134.91 25,392,799	3,181.00 25,766,100	3.68
6	インターアクション	日本	株式	精密機器	10,600	1,428.89 15,146,288	2,362.00 25,037,200	3.57
7	オリエンタルランド	日本	株式	サービス業	2,000	11,529.77 23,059,543	11,130.00 22,260,000	3.18
8	三菱UFJフィナンシャルG	日本	株式	銀行業	36,500	720.30 26,290,950	583.60 21,301,400	3.04
9	武田薬品	日本	株式	医薬品	4,300	4,496.00 19,332,823	4,389.00 18,872,700	2.69
10	東京海上HD	日本	株式	保険業	3,300	5,437.00 17,942,100	5,312.00 17,529,600	2.50
11	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	2,600	7,562.00 19,661,200	6,675.00 17,355,000	2.48
12	三井住友フィナンシャルG	日本	株式	銀行業	4,100	4,699.00 19,265,900	4,045.00 16,584,500	2.37
13	T D K	日本	株式	電気機器	1,800	11,277.36 20,299,255	8,570.00 15,426,000	2.20

14	ソニー	日本	株式	電気機器	2,800	5,310.72 14,870,021	5,467.00 15,307,600	2.18
15	大和ハウス	日本	株式	建設業	4,000	3,891.77 15,567,103	3,527.00 14,108,000	2.01
16	ヤフー	日本	株式	情報・通信業	48,000	315.62 15,149,770	293.00 14,064,000	2.01
17	ニレコ	日本	株式	電気機器	17,200	1,143.26 19,664,164	808.00 13,897,600	1.98
18	三井物産	日本	株式	卸売業	6,700	1,999.00 13,393,300	1,772.50 11,875,750	1.69
19	ダイキン工業	日本	株式	機械	1,000	13,250.00 13,250,000	11,765.00 11,765,000	1.68
20	クレハ	日本	株式	化学	1,700	7,630.00 12,971,000	6,820.00 11,594,000	1.65
21	三井化学	日本	株式	化学	4,000	3,280.00 13,120,000	2,724.00 10,896,000	1.56
22	日本触媒	日本	株式	化学	1,400	8,238.57 11,534,007	7,200.00 10,080,000	1.44
23	ファーストリテイリング	日本	株式	小売業	200	52,960.78 10,592,157	49,830.00 9,966,000	1.42
24	MS & AD	日本	株式	保険業	3,000	3,715.00 11,145,000	3,234.00 9,702,000	1.38
25	日本電産	日本	株式	電気機器	700	17,445.00 12,211,500	13,030.00 9,121,000	1.30
26	ビジョン	日本	株式	その他製品	2,100	5,210.00 10,941,000	4,240.00 8,904,000	1.27
27	信越ポリマー	日本	株式	化学	10,800	1,157.12 12,496,946	819.00 8,845,200	1.26
28	ヤマハ発動機	日本	株式	輸送用機器	3,800	3,350.00 12,730,000	2,326.00 8,838,800	1.26
29	ダイフク	日本	株式	機械	1,600	6,040.00 9,664,000	5,440.00 8,704,000	1.24
30	トーセイ	日本	株式	不動産業	8,500	1,378.11 11,713,954	1,020.00 8,670,000	1.24

(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	95.63%
合計	95.63%

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

八．投資株式の業種別投資比率

業種	投資比率
建設業	2.47%
食料品	0.93%
化学	14.20%
医薬品	3.85%
石油・石炭製品	0.72%
鉄鋼	0.66%
非鉄金属	2.22%
機械	8.40%
電気機器	14.23%
輸送用機器	6.47%
精密機器	5.54%
その他製品	1.27%
電気・ガス業	0.38%
海運業	0.39%
情報・通信業	7.36%
卸売業	6.52%
小売業	1.42%
銀行業	6.35%
保険業	5.12%
その他金融業	0.96%
不動産業	1.85%
サービス業	4.33%
合計	95.63%

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(参考) マザーファンド

ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

(1) 投資状況（2019年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		26,506,830,638	94.72
	内 ユーロ	6,758,731,759	24.15
	内 ノルウェー	579,071,164	2.07
	内 スウェーデン	533,398,725	1.91
	内 デンマーク	804,065,609	2.87
	内 イギリス	3,082,852,320	11.02
	内 ポーランド	1,998,953,093	7.14
	内 カナダ	2,526,523,784	9.03
	内 アメリカ	6,747,736,115	24.11
内 オーストラリア	3,475,498,069	12.42	
特殊債券		957,620,384	3.42
	内 カナダ	957,620,384	3.42
コール・ローン、その他の資産（負債控除後）		519,216,841	1.86
純資産総額		27,983,667,863	100.00

その他の資産の投資状況

投資資産の種類		時価(円)	投資比率(%)
為替予約取引（買建）		2,636,637,747	9.42
	内 日本	2,636,637,747	9.42
為替予約取引（売建）		2,649,293,828	9.47
	内 日本	2,649,293,828	9.47

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

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

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

(2) 投資資産（2019年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	株数、口数	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 (%)
				また は 額面金額				
1	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	45,000,000	89.93 4,409,790,984	93.71 4,594,788,720	1.625000 2026/02/15	16.42

2	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オースト ラリア	国債 証券	24,000,000	118.42 2,244,201,120	125.51 2,378,483,654	4.500000 2033/04/21	8.50
3	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	15,000,000	105.16 1,974,153,645	107.67 2,021,347,710	1.950000 2026/04/30	7.22
4	United Kingdom Gilt	イギリス	国債 証券	9,300,000	122.27 1,624,704,196	123.71 1,643,958,276	5.000000 2025/03/07	5.87
5	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債 証券	15,100,000	98.32 1,230,475,516	102.27 1,280,009,411	2.250000 2025/06/01	4.57
6	SPANISH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	10,000,000	98.78 1,236,231,700	101.83 1,274,465,025	1.400000 2028/04/30	4.55
7	Poland Government Bond	ポーラン ド	国債 証券	37,000,000	111.34 1,202,559,403	111.12 1,200,183,337	5.750000 2021/10/25	4.29
8	CANADIAN GOVERNMENT BOND	カナダ	国債 証券	13,500,000	92.71 1,037,391,969	97.35 1,089,252,057	1.500000 2026/06/01	3.89
9	IRISH TREASURY	ユーロ	国債 証券	8,000,000	101.77 1,018,961,288	103.90 1,040,286,848	1.000000 2026/05/15	3.72
10	FRENCH GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債 証券	5,200,000	135.20 879,893,606	139.56 908,228,568	3.250000 2045/05/25	3.25
11	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	8,000,000	94.25 821,558,400	97.92 853,557,772	2.250000 2025/11/15	3.05
12	Poland Government Bond	ポーラン ド	国債 証券	27,000,000	100.34 790,809,642	101.35 798,769,755	2.250000 2022/04/25	2.85
13	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債 証券	7,400,000	84.42 680,754,404	89.82 724,286,757	2.500000 2046/02/15	2.59
14	United Kingdom Gilt	イギリス	国債 証券	4,500,000	100.10 643,615,819	103.11 662,981,774	1.500000 2026/07/22	2.37
15	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オースト ラリア	国債 証券	6,800,000	115.67 621,096,833	119.50 641,645,067	4.750000 2027/04/21	2.29
16	DANISH GOVERNMENT BOND	デン マーク	国債 証券	34,000,000	110.69 630,761,594	112.60 641,639,840	1.750000 2025/11/15	2.29
17	IRISH TREASURY	ユーロ	国債 証券	3,600,000	130.43 587,666,354	131.01 590,270,475	5.400000 2025/03/13	2.11

18	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	7,000,000	96.18 558,009,491	99.71 578,506,544	2.250000 2025/12/15	2.07
19	SWEDISH GOVERNMENT BOND	スウェーデン	国債証券	36,000,000	106.98 464,486,076	107.58 467,069,328	1.500000 2023/11/13	1.67
20	AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND	オーストラリア	国債証券	5,300,000	109.25 457,202,324	108.81 455,369,347	5.750000 2021/05/15	1.63
21	CANADA HOUSING TRUST	カナダ	特殊債券	4,500,000	98.47 367,272,360	101.65 379,113,840	2.550000 2025/03/15	1.35
22	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	2,800,000	107.36 376,235,441	107.90 378,131,213	1.500000 2023/02/15	1.35
23	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	3,100,000	96.14 324,764,868	97.52 329,409,288	1.375000 2021/04/30	1.18
24	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	2,200,000	101.28 318,372,074	101.40 318,755,564	1.500000 2021/01/22	1.14
25	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	20,000,000	106.49 275,816,870	107.80 279,202,000	3.000000 2024/03/14	1.00
26	Belgium Government Bond	ユーロ	国債証券	1,500,000	143.83 270,012,376	147.18 276,304,918	3.750000 2045/06/22	0.99
27	GERMAN GOVERNMENT BOND	ユーロ	国債証券	1,500,000	133.02 249,715,549	143.66 269,696,998	2.500000 2046/08/15	0.96
28	NORWEGIAN GOVERNMENT BOND	ノルウェー	国債証券	18,000,000	106.26 247,703,715	105.82 246,675,744	3.750000 2021/05/25	0.88
29	United States Treasury Note/Bond	アメリカ	国債証券	2,300,000	93.89 235,315,899	98.03 245,693,577	2.375000 2027/05/15	0.88
30	United Kingdom Gilt	イギリス	国債証券	1,500,000	109.90 235,537,680	109.77 235,278,352	4.000000 2022/03/07	0.84

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

□．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	94.72%
特殊債券	3.42%
合計	98.14%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

(単位：円)

種類	地域	資産名	買建/ 売建	数量	簿価	時価	投資 比率
為替予約取引	日本	豪ドル買/円売 2019年2月	買建	28,000,000	2,185,048,043	2,209,760,000	7.90%
		スウェーデン・クローネ買/円売 2019年2月	買建	35,396,165	429,214,500	426,877,747	1.53%
		カナダ・ドル売/円買 2019年2月	売建	26,617,713	2,185,048,043	2,205,011,328	7.88%
		ユーロ売/円買 2019年2月	売建	3,550,000	441,725,760	444,282,500	1.59%

(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 (2019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	91,357,979,863	95.45
内 香港	4,562,440,042	4.77
内 シンガポール	6,039,222,307	6.31
内 イギリス	8,722,913,101	9.11
内 ベルギー	1,058,008,964	1.11
内 フランス	6,730,047,143	7.03
内 ドイツ	1,081,871,014	1.13
内 スペイン	2,877,823,379	3.01
内 カナダ	2,895,968,716	3.03

	内 アメリカ	46,245,947,949	48.32
	内 オーストラリア	11,143,737,248	11.64
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		4,351,712,471	4.55
純資産総額		95,709,692,334	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)	67,544,863	0.07
内 日本	67,544,863	0.07
為替予約取引(売建)	339,845,571	0.36
内 日本	339,845,571	0.36

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

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

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

(2) 投資資産 (2019年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	株数、口数 また は 額面金額	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
1	LINK REIT	香港	投資証券	3,859,805	1,044.33 4,030,941,924	1,182.03 4,562,440,042	4.77
2	GPT GROUP	オーストラリア	投資証券	7,385,622	420.22 3,104,149,344	459.54 3,394,041,910	3.55
3	UDR INC	アメリカ	投資証券	675,895	4,428.89 2,993,475,738	4,753.92 3,213,154,003	3.36
4	WELLTOWER INC	アメリカ	投資証券	341,535	7,307.83 2,495,884,589	8,346.33 2,850,565,866	2.98
5	PROLOGIS INC	アメリカ	投資証券	378,841	7,278.52 2,757,405,850	7,451.77 2,823,037,665	2.95
6	ESSEX PROPERTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	94,697	27,031.99 2,559,853,014	29,529.24 2,796,331,349	2.92
7	KLEPIERRE	フランス	投資証券	677,941	3,715.20 2,518,758,511	3,789.54 2,569,085,893	2.68
8	BRITISH LAND CO PLC	イギリス	投資証券	2,783,902	843.56 2,348,584,811	838.13 2,333,283,141	2.44

9	SEGRO PLC	イギリス	投資証券	2,371,859	923.00 2,189,237,242	947.58 2,247,526,530	2.35
10	COVIVIO	フランス	投資証券	198,147	11,225.95 2,224,389,305	11,307.30 2,240,508,068	2.34
11	SUN COMMUNITIES INC	アメリカ	投資証券	171,068	11,234.86 1,921,925,988	11,770.94 2,013,632,669	2.10
12	GECINA SA	フランス	投資証券	117,678	18,321.96 2,156,091,609	16,319.56 1,920,453,182	2.01
13	CHARTER HALL GROUP	オーストラリア	投資証券	2,934,087	570.88 1,675,013,934	646.68 1,897,422,423	1.98
14	INVITATION HOMES INC	アメリカ	投資証券	773,179	2,521.33 1,949,518,872	2,431.98 1,880,361,431	1.96
15	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	スペイン	投資証券	1,600,228	1,148.00 1,837,267,291	1,127.60 1,804,419,493	1.89
16	GOODMAN GROUP	オーストラリア	投資証券	1,845,608	851.18 1,570,960,859	951.46 1,756,036,953	1.83
17	KEPPEL DC REIT	シンガポール	投資証券	15,119,513	108.40 1,639,364,811	115.68 1,749,131,100	1.83
18	NATIONAL STORAGE REIT	オーストラリア	投資証券	12,282,483	136.60 1,677,797,004	141.73 1,740,835,619	1.82
19	EXTRA SPACE STORAGE INC	アメリカ	投資証券	153,853	9,825.35 1,511,670,812	10,626.86 1,634,975,645	1.71
20	FORTUNE REIT	シンガポール	投資証券	12,093,070	128.48 1,553,747,866	134.45 1,625,976,145	1.70
21	DIGITAL REALTY TRUST INC	アメリカ	投資証券	134,176	13,335.61 1,789,319,398	11,705.57 1,570,606,936	1.64
22	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	カナダ	投資証券	403,368	3,743.68 1,510,084,587	3,891.21 1,569,592,015	1.64
23	INGENIA COMMUNITIES GROUP	オーストラリア	投資証券	6,011,756	234.51 1,409,824,114	239.24 1,438,305,409	1.50
24	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	シンガポール	投資証券	6,252,477	219.64 1,373,366,515	228.94 1,431,485,852	1.50
25	BOSTON PROPERTIES INC	アメリカ	投資証券	100,673	13,809.91 1,390,289,210	14,214.92 1,431,058,802	1.50
26	KILROY REALTY CORP	アメリカ	投資証券	187,141	7,704.34 1,441,799,203	7,637.00 1,429,197,015	1.49
27	HCP INC	アメリカ	投資証券	416,371	2,913.59 1,213,134,548	3,367.95 1,402,318,208	1.47
28	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	カナダ	投資証券	397,407	4,054.65 1,611,367,404	3,337.57 1,326,376,701	1.39

29	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	アメリカ	投資証 券	224,808	4,826.05 1,084,963,142	5,377.17 1,208,832,182	1.26
30	VICI PROPERTIES INC	アメリカ	投資証 券	511,663	2,315.61 1,184,825,077	2,330.65 1,192,509,622	1.25

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

ロ．投資有価証券の種類別投資比率

投資有価証券の種類	投資比率
投資証券	95.45%
合計	95.45%

(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	ユーロ買/円売 2019年2月	買建	216,149	27,065,467	27,051,022	0.03%
		米ドル買/円売 2019年2月	買建	371,674	40,485,422	40,493,841	0.04%
		英ポンド売/円買 2019年2月	売建	283,353	40,485,422	40,482,588	0.04%
		米ドル売/円買 2019年2月	売建	2,748,398	299,368,467	299,362,983	0.31%

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

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

(注3) 為替予約取引の数量については、現地通貨建契約金額です。

ダイワJ - REITアクティブ・マザーファンド

(1) 投資状況 (2019年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		106,297,553,000	98.37
	内 日本	106,297,553,000	98.37
コール・ローン、その他の資産(負債控除後)		1,762,472,868	1.63
純資産総額		108,060,025,868	100.00

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

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

(2) 投資資産 (2019年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	株数、口数	簿価単価 簿価 (円)	評価単価 時価 (円)	投資 比率 (%)
				また は 額面金額			
1	ジャパンリアルエステイト	日本	投資証券	16,159	609,000.00 9,840,831,000	638,000.00 10,309,442,000	9.54
2	野村不動産マスターF	日本	投資証券	43,847	146,779.03 6,435,820,416	155,900.00 6,835,747,300	6.33
3	日本ビルファンド	日本	投資証券	7,309	679,000.00 4,962,811,000	704,000.00 5,145,536,000	4.76
4	オリックス不動産投資	日本	投資証券	26,544	177,400.00 4,708,905,600	190,300.00 5,051,323,200	4.67
5	日本リテールファンド	日本	投資証券	20,028	214,600.00 4,298,008,800	223,000.00 4,466,244,000	4.13
6	日本プロロジスリート	日本	投資証券	18,781	239,200.00 4,492,415,200	237,500.00 4,460,487,500	4.13
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	15,544	247,700.00 3,850,248,800	256,200.00 3,982,372,800	3.69
8	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	5,012	725,000.00 3,633,700,000	747,000.00 3,743,964,000	3.46
9	積水ハウス・リート投資	日本	投資証券	42,998	70,800.00 3,044,258,400	76,200.00 3,276,447,600	3.03
10	アドバンス・レジデンス	日本	投資証券	9,965	297,471.22 2,964,300,776	322,000.00 3,208,730,000	2.97
11	森ヒルズリート	日本	投資証券	22,201	139,300.00 3,092,599,300	144,500.00 3,208,044,500	2.97

12	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	16,967	177,007.18 3,003,280,955	173,700.00 2,947,167,900	2.73
13	ヒューリックリート投資法	日本	投資証券	15,524	164,400.00 2,552,145,600	178,900.00 2,777,243,600	2.57
14	API投資法人	日本	投資証券	5,240	485,000.00 2,541,400,000	471,500.00 2,470,660,000	2.29
15	日本リート投資法人	日本	投資証券	6,151	369,000.00 2,269,719,000	385,500.00 2,371,210,500	2.19
16	フロンティア不動産投資	日本	投資証券	5,264	441,602.70 2,324,596,618	445,000.00 2,342,480,000	2.17
17	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	27,498	80,400.00 2,210,839,200	83,500.00 2,296,083,000	2.12
18	森トラスト総合リート	日本	投資証券	13,246	162,763.97 2,155,971,618	168,700.00 2,234,600,200	2.07
19	星野リゾート・リート	日本	投資証券	4,123	537,000.00 2,214,051,000	536,000.00 2,209,928,000	2.05
20	GLP投資法人	日本	投資証券	18,573	112,600.00 2,091,319,800	115,700.00 2,148,896,100	1.99
21	ケネディクス商業リート	日本	投資証券	8,173	241,900.00 1,977,048,700	259,100.00 2,117,624,300	1.96
22	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	11,163	172,377.49 1,924,249,953	180,100.00 2,010,456,300	1.86
23	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	2,580	721,000.00 1,860,180,000	728,000.00 1,878,240,000	1.74
24	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	39,462	46,400.00 1,831,036,800	47,350.00 1,868,525,700	1.73
25	MCUBS MidCity投資法人	日本	投資証券	19,677	87,710.73 1,725,884,131	91,900.00 1,808,316,300	1.67
26	福岡リート投資法人	日本	投資証券	10,312	168,342.04 1,735,943,166	170,000.00 1,753,040,000	1.62
27	日本プライムリアルティ	日本	投資証券	3,382	415,500.00 1,405,221,000	443,500.00 1,499,917,000	1.39
28	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	9,497	150,005.56 1,424,602,839	155,600.00 1,477,733,200	1.37
29	日本賃貸住宅投資法人	日本	投資証券	16,590	90,000.00 1,493,100,000	85,600.00 1,420,104,000	1.31
30	プレミア投資法人	日本	投資証券	10,376	122,800.00 1,274,172,800	132,900.00 1,378,970,400	1.28

(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	98.37%
合計	98.37%

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

八．投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(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）

2019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	9,404円
純資産総額	98百万円



※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: 120円 設定来分配金合計額: 2,460円

決算期	第63期	第64期	第65期	第66期	第67期	第68期	第69期	第70期	第71期	第72期	第73期	第74期
	17年3月	17年5月	17年7月	17年9月	17年11月	18年1月	18年3月	18年5月	18年7月	18年9月	18年11月	19年1月
分配金	30円	30円	20円	20円	20円	20円	20円	20円	20円	20円	20円	20円

※分配金は、収益配分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	66	44.0%	日本円	52.2%	直接利回り(%)	小松製作所	機械	2.0%
外国債券	35	36.9%	米ドル	14.5%	最終利回り(%)	信越化学	化学	1.8%
外国リート	70	9.8%	ユーロ	10.0%	修正デュレーション	伊藤忠テクノソリューションズ	情報・通信業	1.8%
国内リート	50	4.8%	豪ドル	8.9%	残存年数	村田製作所	電気機器	1.7%
			英ポンド	5.2%	債券格付別構成 比率	三菱商事	卸売業	1.7%
			ポーランド・ズロチ	2.8%	AAA	LINK REIT	商業施設	0.5%
			カナダ・ドル	2.1%	AA	ジャパンリアルエステイト	オフィス不動産	0.5%
			スウェーデン・クローネ	1.3%	A	GPT GROUP	各種不動産	0.4%
			デンマーク・クローネ	1.1%	BBB	UDR INC	住宅	0.3%
コール・ローン、その他		4.5%	その他	2.0%	BB	WELLTOWER INC	ヘルスケア	0.3%
合計	221	100.0%	合計	100.0%	合計	合計	合計	10.9%

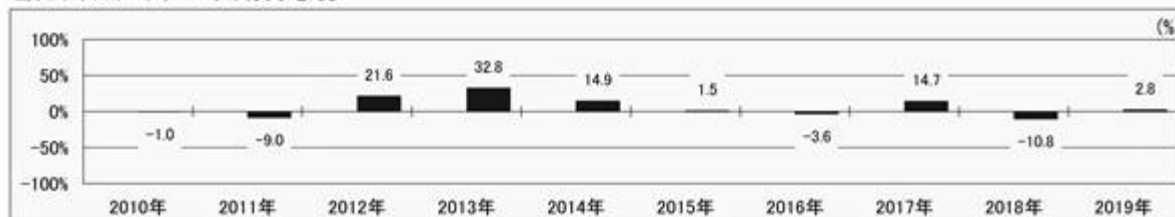
※債券格付別構成の比率は、債券ポートフォリオに対するものです。

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

※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。

・2019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】

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

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

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

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

ただし、販売会社は、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。

お買付価額（1万口当たり）は、お買付申込受付日の翌営業日の基準価額です。

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

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

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

2 【換金(解約)手続等】

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

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

<一部解約>

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

ただし、販売会社は、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。

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

解約価額は、一部解約の実行の請求受付日の翌営業日の基準価額とします。

解約価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

・お電話によるお問合わせ先（委託会社）

電話番号（コールセンター） 0120-106212

（営業日の9:00～17:00）

・委託会社のホームページ

アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>

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

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

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

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

3 【資産管理等の概要】

(1) 【資産の評価】

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

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

(注1) 主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・「(F0Fs専用)ダイワSRIファンド(適格機関投資家専用)」の受益証券：計算日の前営業日の基準価額で評価します。
- ・マザーファンドの受益証券：計算日の基準価額で評価します。

(注2) マザーファンドの主要な投資対象資産の評価方法の概要

- ・わが国の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日の最終相場で評価します。
- ・海外の金融商品取引所上場の不動産投資信託証券：原則として当該取引所における計算日に知り得る直近の日の最終相場で評価します。
- ・公社債等：原則として、次に掲げるいずれかの価額で評価します。
 1. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）
 2. 価格情報会社の提供する価額

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

基準価額は、原則として、委託会社の各営業日に計算されます。

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

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

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

毎年1月16日から3月15日まで、3月16日から5月15日まで、5月16日から7月15日まで、7月16日から9月15日まで、9月16日から11月15日まで、および11月16日から翌年1月15日までとします。ただし、第1計算期間は、2006年9月27日から2006年11月15日までとします。

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

(5) 【その他】

信託の終了

1. 委託会社は、受益権の口数が10億口を下ることとなった場合もしくは信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意

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

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

信託約款の変更

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

反対者の買取請求権

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

運用報告書

1. 委託会社は、運用経過のほか信託財産の内容、有価証券売買状況、費用明細などのうち重要な事項を記載した交付運用報告書（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第4項に定める運用報告書）を毎年1月および7月の計算期末に作成し、信託財産にかかる知られたる受益者に対して交付します。また、電子交付を選択された場合には、所定の方法により交付します。
2. 委託会社は、運用報告書（全体版）（投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書）を作成し、委託会社のホームページに掲載します。
 - ・委託会社のホームページ
アドレス <https://www.daiwa-am.co.jp/>
3. 前2.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合には、これを交付します。

公告

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

関係法人との契約の更改

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

4 【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利の内容、その行使の方法等は、次のとおりです。

収益分配金および償還金にかかる請求権

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

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

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

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

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

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

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

換金請求権

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

第3 【ファンドの経理状況】

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

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

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

(3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当特定期間(平成30年7月18日から平成31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せん。

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】

（単位：円）

	前 期 平成30年7月17日現在	当 期 平成31年1月15日現在
資産の部		
流動資産		
金銭信託	342,308	102,137
コール・ローン	1,086,428	1,262,592
投資信託受益証券	47,062,693	44,790,835
親投資信託受益証券	58,031,204	50,879,033
流動資産合計	106,522,633	97,034,597
資産合計	106,522,633	97,034,597
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	212,587	210,431
未払受託者報酬	9,994	8,953
未払委託者報酬	190,140	170,419
その他未払費用	4,410	4,078
流動負債合計	417,131	393,881
負債合計	417,131	393,881
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 106,293,524	¹ 105,215,864
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	² 188,022	² 8,575,148
（分配準備積立金）	5,706,430	5,202,012
元本等合計	106,105,502	96,640,716
純資産合計	106,105,502	96,640,716
負債純資産合計	106,522,633	97,034,597

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	前 期		当 期	
	自 平成30年1月16日 至 平成30年7月17日		自 平成30年7月18日 至 平成31年1月15日	
営業収益				
有価証券売買等損益		4,564,500		7,224,029
営業収益合計		4,564,500		7,224,029
営業費用				
支払利息		330		350
受託者報酬		29,776		27,697
委託者報酬		1,566,600		1,527,112
その他費用		4,440		4,094
営業費用合計		601,146		559,253
営業損失（ ）		5,165,646		7,783,282
経常損失（ ）		5,165,646		7,783,282
当期純損失（ ）		5,165,646		7,783,282
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		83,260		20,777
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		5,636,963		188,022
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,260		10,229
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		10,229
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,260		-
剰余金減少額又は欠損金増加額		87,360		2,126
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		87,360		-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		2,126
分配金		2,656,499		2,632,724
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		188,022		8,575,148

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当 期	
	自 平成30年7月18日	至 平成31年1月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1)投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p> <p>(2)親投資信託受益証券</p> <p>移動平均法に基づき、時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、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。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>特定期間末日</p> <p>平成30年7月15日及びその翌日が休日のため、前特定期間末日を平成30年7月17日としております。このため、当特定期間は182日となっております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	前 期	当 期
	平成30年7月17日現在	平成31年1月15日現在
1. 1 期首元本額	116,079,091円	106,293,524円
期中追加設定元本額	156,896円	154,413円
期中一部解約元本額	9,942,463円	1,232,073円
2. 特定期間末日における受益権の総数	106,293,524口	105,215,864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188,022円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は8,575,148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 自 平成30年1月16日 至 平成30年7月17日	当 期 自 平成30年7月18日 至 平成31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	26,973円
2. 2 分配金の計算過程	(自平成30年1月16日 至平成30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(82,371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(1,511,607円)及び分配準備積立金(6,253,192円)より分配対象額は7,847,170円(1万口当たり696.73円)であり、うち225,256円(1万口当たり20円)を分配金額としております。	(自平成30年7月18日 至平成30年9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(66,690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(1,430,682円)及び分配準備積立金(5,686,968円)より分配対象額は7,184,340円(1万口当たり677.88円)であり、うち211,964円(1万口当たり20円)を分配金額としております。

<p>(自平成30年3月16日 至平成30年5月15日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(250,534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(1,470,127円)及び分配準備積立金(5,928,495円)より分配対象額は7,649,156円(1万口当たり699.65円)であり、うち218,656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30年9月19日 至平成30年11月15日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(53,534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(1,422,348円)及び分配準備積立金(5,496,258円)より分配対象額は6,972,140円(1万口当たり662.97円)であり、うち210,329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30年5月16日 至平成30年7月17日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(126,817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(1,432,085円)及び分配準備積立金(5,792,200円)より分配対象額は7,351,102円(1万口当たり691.59円)であり、うち212,587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30年11月16日 至平成31年1月15日)</p> <p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(72,980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(1,425,670円)及び分配準備積立金(5,339,463円)より分配対象額は6,838,113円(1万口当たり649.91円)であり、うち210,431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30年7月18日 至 平成31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31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

	前 期	当 期
	平成30年7月17日現在	平成31年1月15日現在

種 類	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)	最終の計算期間の損益に 含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	1,413,967	3,841,458
親投資信託受益証券	1,689,319	1,283,826
合計	275,352	5,125,284

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

前 期 平成30年7月17日現在	当 期 平成31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30年7月18日 至 平成31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なわれていないため、該当事項はありません。

(1口当たり情報)

	前 期 平成30年7月17日現在	当 期 平成31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)	0.9982円 (9,982円)	0.9185円 (9,185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	(FOFs専用)ダイワSRIファンド (適格機関投資家専用)	40,946,006	44,790,835	
投資信託受益証券	合計		44,790,835	
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	22,436,633	36,731,011	
	ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド	4,310,926	9,551,287	

	ダイワJ-REITアクティブ・マ ザーファンド	1,772,953	4,596,735	
親投資信託受益証券	合計		50,879,033	
合計			95,669,868	

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。

「(F0Fs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24期計算期間(平成30年5月22日から平成30年11月19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 S R I ファンド (適格機関投資家専用)

(1) 貸借対照表

	第23期	第24期
	平成30年5月21日現在	平成30年11月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	436,804	220,056
コール・ローン	-	187,498
親投資信託受益証券	49,603,246	44,286,676
流動資産合計	50,040,050	44,694,230
資産合計	50,040,050	44,694,230
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	16,509	15,126
未払委託者報酬	201,327	184,626
その他未払費用	1,333	1,176
流動負債合計	219,169	200,928
負債合計	219,169	200,928
純資産の部		
元本等		
元本	1 38,395,615	37,252,561
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	11,425,266	7,240,741
(分配準備積立金)	13,689,712	13,536,436
元本等合計	49,820,881	44,493,302
純資産合計	49,820,881	44,493,302
負債純資産合計	50,040,050	44,694,230

(2) 損益及び剰余金計算書

	第23期	第24期
	自 平成29年11月21日 至 平成30年5月21日	自 平成30年5月22日 至 平成30年11月19日
	金額(円)	金額(円)

営業収益		
有価証券売買等損益	1,168,010	3,726,570
営業収益合計	1,168,010	3,726,570
営業費用		
支払利息	2	10
受託者報酬	16,509	15,126
委託者報酬	201,327	184,626
その他費用	1,341	1,249
営業費用合計	219,179	201,011
営業利益又は営業損失（ ）	948,831	3,927,581
経常利益又は経常損失（ ）	948,831	3,927,581
当期純利益又は当期純損失（ ）	948,831	3,927,581
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は 一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	209,845	83,191
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	12,774,297	11,425,266
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,088,017	340,135
当期一部解約に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額	2,088,017	340,135
分配金	1	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,425,266	7,240,741

(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24期	
	自 平成30年5月22日 至 平成30年11月19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30年5月19日及びその翌日が休日のため、前計算期間末日を平成30年5月21日としております。このため、当計算期間は182日となっております。	

（貸借対照表に関する注記）

区 分	第23期	第24期
	平成30年5月21日現在	平成30年11月19日現在
1. 1 期首元本額	45,897,746円	38,395,615円
期中追加設定元本額	- 円	- 円
期中一部解約元本額	7,502,131円	1,143,054円
2. 計算期間末日における受益 権の総数	38,395,615口	37,252,561口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

区 分	第23期	第24期
	自 平成29年11月21日 至 平成30年5月21日	自 平成30年5月22日 至 平成30年11月19日
1 分配金の計算過程	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（314,824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（424,162円）、投資信託約款に規定される収益調整金（1,355,301円）及び分配準備積立金（12,950,726円）より分配対象額は15,045,013円（1万口当たり3,918.42円）であり、分配を行っておりません。	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（254,272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（1,314,953円）及び分配準備積立金（13,282,164円）より分配対象額は14,851,389円（1万口当たり3,986.68円）であり、分配を行っておりません。

（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24期
	自 平成30年5月22日 至 平成30年11月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。

2. 金融商品の内容及びリスク	当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細を附属明細表に記載しております。なお、当ファンドは、親投資信託受益証券を通じて有価証券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	第24期 平成30年11月19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23期 平成30年5月21日現在	第24期 平成30年11月19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	959,356	3,635,170
合計	959,356	3,635,170

（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23期 平成30年5月21日現在	第24期 平成30年11月19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24期 自 平成30年5月22日 至 平成30年11月19日
市場価格その他当該取引に係る価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第23期 平成30年5月21日現在	第24期 平成30年11月19日現在
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2976円 (12,976円)	1.1944円 (11,944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SRIマザーファンド	20,642,620	44,286,676	
親投資信託受益証券 合計			44,286,676	
合計			44,286,676	

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SRI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SRIマザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年5月21日現在	平成30年11月19日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	28,202,695	11,726,426
コール・ローン	-	9,991,502
株式	742,084,000	696,320,050
未収入金	4,920,007	6,536,349
未収配当金	6,069,650	6,574,000
流動資産合計	781,276,352	731,148,327
資産合計	781,276,352	731,148,327
負債の部		
流動負債		
その他未払費用	1,075	912
流動負債合計	1,075	912
負債合計	1,075	912
純資産の部		
元本等		
元本	1 336,544,675	340,795,617
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	444,730,602	390,351,798
元本等合計	781,275,277	731,147,415
純資産合計	781,275,277	731,147,415
負債純資産合計	781,276,352	731,148,327

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成30年5月22日 至 平成30年11月19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30年5月21日現在	平成30年11月19日現在
1. 1 期首	平成29年11月21日	平成30年5月22日
期首元本額	331,844,091円	336,544,675円
期中追加設定元本額	33,813,193円	20,286,186円
期中一部解約元本額	29,112,609円	16,035,244円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
（F0Fs専用）ダイワSRI ファンド（適格機関投資家専 用）	21,366,895円	20,642,620円
DC・ダイワSRIファンド	315,177,780円	320,152,997円
計	336,544,675円	340,795,617円
2. 期末日における受益権の総数	336,544,675口	340,795,617口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年5月22日 至 平成30年11月19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11月19日現在
1. 金融商品の時価及び貸借対照表計上額との差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 金融商品の時価の算定方法	(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。 (2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成30年5月21日現在	平成30年11月19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	69,663,603	60,245,086
合計	69,663,603	60,245,086

（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20日から平成30年5月21日まで、及び平成30年5月22日から平成30年11月19日まで）を指しております。

（デリバティブ取引に関する注記）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

平成30年5月21日現在	平成30年11月19日現在
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	平成30年5月21日現在	平成30年11月19日現在
1口当たり純資産額	2,3215円	2,1454円
（1万口当たり純資産額）	（23,215円）	（21,454円）

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

銘柄	株式数	評価額（円）		備考
		単価	金額	
五洋建設	5,000	677.00	3,385,000	
大和ハウス	1,800	3,417.00	6,150,600	
ヤクルト	900	8,260.00	7,434,000	
ヒューリック	7,300	1,057.00	7,716,100	
昭和電工	800	4,495.00	3,596,000	
クレハ	1,700	7,400.00	12,580,000	
信越化学	3,000	9,693.00	29,079,000	
日本触媒	1,400	7,160.00	10,024,000	
三井化学	4,000	2,953.00	11,812,000	
J S R	4,000	1,746.00	6,984,000	
三菱ケミカルH L D G S	9,000	925.30	8,327,700	
積水化学	3,000	1,869.00	5,607,000	
タキロンシーアイ	7,000	576.00	4,032,000	
花 王	400	8,032.00	3,212,800	
アステラス製薬	1,700	1,709.00	2,905,300	
塩野義製薬	800	7,680.00	6,144,000	
テ ル モ	1,300	6,334.00	8,234,200	
オリエンタルランド	2,000	10,915.00	21,830,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	5,800	2,045.00	11,861,000	
J X T Gホールディングス	8,500	681.70	5,794,450	
J F Eホールディングス	10,200	2,078.00	21,195,600	

住友鉱山	2,300	3,160.00	7,268,000
住友電工	5,400	1,574.50	8,502,300
タクマ	3,500	1,491.00	5,218,500
豊田自動織機	1,500	5,650.00	8,475,000
小松製作所	11,000	2,942.50	32,367,500
ダイキン工業	1,000	11,725.00	11,725,000
ダイフク	1,600	5,530.00	8,848,000
日本ピストンリング	1,800	2,064.00	3,715,200
日立	2,600	3,316.00	8,621,600
ウェルビー	4,700	1,901.00	8,934,700
日本電産	700	14,345.00	10,041,500
セイコーエプソン	3,600	1,869.00	6,728,400
ソニー	3,300	5,891.00	19,440,300
T D K	1,800	8,850.00	15,930,000
リオン	2,600	2,102.00	5,465,200
堀場製作所	400	5,050.00	2,020,000
ニレコ	17,200	894.00	15,376,800
デンソー	1,700	5,124.00	8,710,800
ローム	1,100	7,960.00	8,756,000
太陽誘電	2,300	2,026.00	4,659,800
村田製作所	1,700	16,280.00	27,676,000
トヨタ自動車	2,600	6,612.00	17,191,200
本田技研	800	3,179.00	2,543,200
ヤマハ発動機	3,800	2,295.00	8,721,000
島津製作所	2,300	2,508.00	5,768,400
インターアクション	16,100	2,415.00	38,881,500
ピジョン	2,100	5,040.00	10,584,000
信越ポリマー	10,800	870.00	9,396,000
伊藤忠	2,000	2,024.00	4,048,000
三井物産	6,700	1,770.50	11,862,350
住友商事	2,400	1,734.00	4,161,600
三菱商事	8,100	3,012.00	24,397,200
三菱UFJフィナンシャルG	36,500	639.40	23,338,100
三井住友トラストHD	1,600	4,439.00	7,102,400
三井住友フィナンシャルG	4,100	4,183.00	17,150,300
オリックス	4,100	1,802.00	7,388,200
MS&AD	3,000	3,447.00	10,341,000
第一生命HLDS	8,900	2,032.50	18,089,250
東京海上HD	3,300	5,530.00	18,249,000
トーセイ	8,500	1,002.00	8,517,000

商船三井	1,000	2,615.00	2,615,000	
九州電力	2,000	1,362.00	2,724,000	
J B C Cホールディングス	3,000	1,706.00	5,118,000	
ファーストリテイリング	200	58,740.00	11,748,000	
合計			696,320,050	

(2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

「ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年7月17日現在	平成31年1月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	159,226,241	119,518,127
金銭信託	15,393,114	1,180,161
コール・ローン	48,855,179	14,588,890
国債証券	29,186,499,042	26,246,140,827
特殊債券	977,846,464	938,417,142
派生商品評価勘定	10,762,572	23,247,923
未収入金	55,506,269	-
未収利息	248,442,383	249,221,274
前払費用	13,529	-
差入委託証拠金	132,276,670	126,283,430
流動資産合計	30,834,821,463	27,718,597,774
資産合計	30,834,821,463	27,718,597,774
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定	6,971,000	3,596,670
未払解約金	74,416,642	9,794,330
その他未払費用	11,179	375
流動負債合計	81,398,821	13,391,375
負債合計	81,398,821	13,391,375
純資産の部		
元本等		
元本	1 18,182,343,057	16,923,301,769
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	12,571,079,585	10,781,904,630
元本等合計	30,753,422,642	27,705,206,399
純資産合計	30,753,422,642	27,705,206,399
負債純資産合計	30,834,821,463	27,718,597,774

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

区 分	自 平成30年7月18日 至 平成31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。</p> <p>時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>

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

（貸借対照表に関する注記）

区 分	平成30年7月17日現在	平成31年1月15日現在
1. 1 期首	平成30年1月16日	平成30年7月18日
期首元本額	19,065,320,764円	18,182,343,057円
期中追加設定元本額	343,558,641円	179,661,350円
期中一部解約元本額	1,226,536,348円	1,438,702,638円
期末元本額の内訳		
ファンド名		
ダイワF0Fs用外債ソブリン・オープン（適格機関投資家専用）	1,811,447,157円	1,641,551,273円
富山応援ファンド（地域企業株・外債バランス/毎月分配型）	662,050,769円	629,229,180円
ダイワ外債ソブリン・オープン（毎月分配型）	992,672,238円	923,891,701円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	50,416,068円	46,125,479円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	199,729,122円	179,323,093円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	367,457,671円	337,431,035円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	537,623,611円	479,615,608円
京都応援バランスファンド（隔月分配型）	237,093,235円	224,163,812円

6 資産バランスファンド（分配型）	1,145,684,383円	1,079,072,469円
6 資産バランスファンド（成長型）	126,201,219円	115,967,840円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（毎月分配型）	7,836,722,741円	7,278,381,818円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	69,875,152円	65,068,519円
ダイワ外債ソブリン・ファンド（毎月分配型）	344,062,710円	305,647,314円
兵庫応援バランスファンド（毎月分配型）	978,308,761円	998,054,344円
『しがぎん』SRI三資産バランス・オープン（奇数月分配型）	25,095,750円	22,436,633円
ダイワ・株/債券/コモディティ・バランスファンド	282,971,574円	242,779,211円
紀陽地域株式・外債バランスファンド（隔月分配型）	50,169,127円	- 円
ダイワ資産分散インカムオープン（奇数月決算型）	1,142,653,093円	1,021,507,744円
ダイワ海外ソブリン・ファンド（1年決算型）	15,440,724円	13,932,756円
四国アライアンス 地域創生ファンド（年1回決算型）	873,960,417円	885,165,398円
四国アライアンス 地域創生ファンド（年2回決算型）	432,707,535円	433,956,542円
計	18,182,343,057円	16,923,301,769円
2. 期末日における受益権の総数	18,182,343,057口	16,923,301,769口

（金融商品に関する注記）

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成30年7月18日 至 平成31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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動、金利変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>信託財産の効率的な運用に資すること、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。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成31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	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

	平成30年7月17日現在	平成31年1月15日現在
--	--------------	--------------

種 類	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)	当期間の損益に 含まれた評価差額(円)
国債証券	6,191,046	698,343,331
特殊債券	1,857,092	26,420,588
合計	4,333,954	724,763,919

(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30年4月11日から平成30年7月17日まで、及び平成30年10月11日から平成31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30年7月17日 現在				平成31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	1,643,560,000	-	1,650,415,000	6,855,000	2,615,225,953	-	2,608,679,077	6,546,876
アメリカ・ドル	45,088,000	-	44,972,000	116,000	-	-	-	-
オーストラリア・ ドル	1,154,534,000	-	1,157,731,000	3,197,000	-	-	-	-
カナダ・ドル	-	-	-	-	2,184,872,953	-	2,179,533,577	5,339,376
ユーロ	443,938,000	-	447,712,000	3,774,000	430,353,000	-	429,145,500	1,207,500
買 建	1,598,472,000	-	1,609,118,572	10,646,572	2,615,225,953	-	2,628,330,330	13,104,377
オーストラリア・ ドル	-	-	-	-	2,184,872,953	-	2,201,574,000	16,701,047
カナダ・ドル	1,154,534,000	-	1,164,807,601	10,273,601	-	-	-	-
スウェーデン・ クローナ	443,938,000	-	444,310,971	372,971	430,353,000	-	426,756,330	3,596,670
合計	3,242,032,000	-	3,259,533,572	3,791,572	5,230,451,906	-	5,237,009,407	19,651,253

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成30年7月17日現在	平成31年1月15日現在
1口当たり純資産額	1.6914円	1.6371円
(1万口当たり純資産額)	(16,914円)	(16,371円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカ・ドル	2.25% United States Treasury Note/Bond 20251115	8,000,000.000	7,819,360.000	
		1.625% United States Treasury Note/Bond 20260215	45,000,000.000	42,116,850.000	
		2.5% United States Treasury Note/Bond 20460215	7,400,000.000	6,629,290.000	
		1.375% United States Treasury Note/Bond 20210430	3,100,000.000	3,021,043.000	
		2.375% United States Treasury Note/Bond 20270515	2,300,000.000	2,250,941.000	

アメリカ・ドル 小計			アメリカ・ドル 61,837,484.000 (6,703,183,265)	
イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	イギリス・ポンド	
	1.5% United Kingdom Gilt 20210122	2,200,000.000	2,230,602.000	
	1.5% United Kingdom Gilt 20260722	4,500,000.000	4,630,140.000	
	5% United Kingdom Gilt 20250307	9,300,000.000	11,494,149.000	
	4.25% United Kingdom Gilt 20461207	1,000,000.000	1,530,500.000	
4% United Kingdom Gilt 20220307	1,500,000.000	1,648,065.000		
イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 21,533,456.000 (3,007,362,465)	
オーストラリア・ドル		オーストラリア・ドル	オーストラリア・ドル	
	5.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20210515	5,700,000.000	6,209,751.000	
	4.75% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20270421	6,800,000.000	8,106,484.000	
4.5% AUSTRALIAN GOVERNMENT BOND 20330421	24,000,000.000	29,999,520.000		
オーストラリア・ドル 小計			オーストラリア・ドル 44,315,755.000 (3,461,946,780)	
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	1,898,145.000	
	2.25% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20250601	15,100,000.000	15,401,849.000	
1.5% CANADIAN GOVERNMENT BOND 20260601	13,500,000.000	13,107,690.000		
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 30,407,684.000 (2,484,003,706)	
スウェーデン・クローナ		スウェーデン・クローナ	スウェーデン・クローナ	

	5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20201201	5,000,000.000	5,509,350.000	
	1.5% SWEDISH GOVERNMENT BOND 20231113	36,000,000.000	38,757,240.000	
スウェーデン・クローナ 小計			スウェーデン・クローナ 44,266,590.000 (536,511,071)	
デンマーク・クローネ	4.5% DANISH GOVERNMENT BOND 20391115	5,500,000.000	9,661,190.000	
	1.75% DANISH GOVERNMENT BOND 20251115	34,000,000.000	38,264,620.000	
デンマーク・クローネ 小計			デンマーク・クローネ 47,925,810.000 (798,443,995)	
ノルウェー・クローネ	3.75% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20210525	18,000,000.000	19,092,060.000	
	2% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20230524	4,000,000.000	4,115,800.000	
	3% NORWEGIAN GOVERNMENT BOND 20240314	20,000,000.000	21,594,600.000	
ノルウェー・クローネ 小計			ノルウェー・クローネ 44,802,460.000 (568,543,217)	
ポーランド・ズロチ	2.25% Poland Government Bond 20220425	27,000,000.000	27,445,500.000	
	5.75% Poland Government Bond 20211025	37,000,000.000	41,119,950.000	
ポーランド・ズロチ 小計			ポーランド・ズロチ 68,565,450.000 (1,986,341,087)	
ユーロ	1.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20230215	2,800,000.000	3,025,876.000	
	2.5% GERMAN GOVERNMENT BOND 20460815	1,500,000.000	2,132,265.000	

		3.25% FRENCH GOVERNMENT BOND 20450525	5,200,000.000	7,204,444.000	
		3.75% Belgium Government Bond 20450622	1,500,000.000	2,194,920.000	
		5.4% IRISH TREASURY 20250313	3,800,000.000	4,979,330.000	
		1% IRISH TREASURY 20260515	8,000,000.000	8,280,800.000	
		1.95% SPANISH GOVERNMENT BOND 20260430	15,000,000.000	15,994,650.000	
		1.4% SPANISH GOVERNMENT BOND 20280430	10,000,000.000	10,049,000.000	
	ユーロ	小計		ユーロ 53,861,285.000 (6,699,805,241)	
国債証券 合計				26,246,140,827 [26,246,140,827]	
特殊債券	カナダ・ドル	2.55% CANADA HOUSING TRUST 20250315	カナダ・ドル 4,500,000.000	カナダ・ドル 4,549,140.000	
		2.25% CANADA HOUSING TRUST 20251215	7,000,000.000	6,938,400.000	
	カナダ・ドル	小計		カナダ・ドル 11,487,540.000 (938,417,142)	
特殊債券 合計				938,417,142 [938,417,142]	
合計				27,184,557,969 [27,184,557,969]	

- (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%	24.7%
イギリス・ポンド	国債証券 5銘柄	100%	11.1%
オーストラリア・ドル	国債証券 3銘柄	100%	12.7%
カナダ・ドル	国債証券 3銘柄	100%	12.6%
	特殊債券 2銘柄		
スウェーデン・クローナ	国債証券 2銘柄	100%	2.0%
デンマーク・クローネ	国債証券 2銘柄	100%	2.9%

ノルウェー・クローネ	国債証券	3銘柄	100%	2.1%
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%	24.6%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年7月17日現在	平成31年1月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	3,842,992,473	2,451,954,886
金銭信託	118,957,120	47,404,168
コール・ローン	377,550,090	586,000,132
投資証券	99,837,863,034	87,276,463,970
派生商品評価勘定	594,114	443,695
未収入金	386,411,327	8,259,107
未収配当金	451,089,579	372,382,642
流動資産合計	105,015,457,737	90,742,908,600
資産合計	105,015,457,737	90,742,908,600
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	376,595	120,160
未払金	548,815,483	391,092,392
未払解約金	218,568,000	51,000,000
その他未払費用	17,714	5,245
流動負債合計	767,777,792	442,217,797
負債合計	767,777,792	442,217,797
純資産の部		
元本等		
元本	1 44,522,248,904	40,756,750,618

剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	59,725,431,041	49,543,940,185
元本等合計	104,247,679,945	90,300,690,803
純資産合計	104,247,679,945	90,300,690,803
負債純資産合計	105,015,457,737	90,742,908,600

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年7月18日 至 平成31年1月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、外国金融商品市場又は店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。</p> <p>なお、適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的な事由をもって時価と認めた価額又は受託会社と協議のうえ両者が合理的な事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2. デリバティブ取引の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、原則として計算日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として、投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p>

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30年7月17日現在	平成31年1月15日現在
1. 1 期首	平成30年1月16日	平成30年7月18日
期首元本額	49,323,381,024円	44,522,248,904円
期中追加設定元本額	146,682,263円	108,701,298円
期中一部解約元本額	4,947,814,383円	3,874,199,584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）	40,175,989,016円	36,649,098,324円
ダイワ・バランス3資産（外債・海外リート・好配当日本株）	37,560,022円	32,937,857円
安定重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	20,532,037円	17,940,110円
インカム重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	18,606,111円	16,895,462円
成長重視ポートフォリオ（奇数月分配型）	96,362,760円	84,706,741円
6資産バランスファンド（分配型）	165,629,626円	153,611,646円
6資産バランスファンド（成長型）	381,975,136円	344,600,916円
りそな ワールド・リート・ファンド	1,769,425,802円	1,595,047,787円
世界6資産均等分散ファンド（毎月分配型）	50,660,598円	46,338,729円

『しがぎん』S R I三資産バ ランス・オープン(奇数月分 配型)	4,488,050円	4,310,926円
常陽3分法ファンド	244,007,418円	221,126,129円
ダイワ資産分散インカムオー プン(奇数月決算型)	58,161,814円	52,169,101円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/安定コース)	219,117,754円	240,210,682円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/6分散コー ス)	297,642,802円	318,129,896円
D Cダイワ・ワールドアセッ ト(六つの羽/成長コース)	377,974,003円	393,632,938円
ダイワ・グローバルR E I T ファンド(ダイワS M A専 用)	50,327,337円	50,327,337円
ライフハーモニー(ダイワ世 界資産分散ファンド)(分配 型)	489,625,055円	475,679,615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)	27,829,426円	26,810,898円
ダイワ外国3資産バランス・ ファンド(為替ヘッジなし)	36,334,137円	33,175,524円
計	44,522,248,904円	40,756,750,618円
2. 期末日における受益権の総数	44,522,248,904口	40,756,750,618口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成30年7月18日 至 平成31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	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、金銭債権及び金銭債務等であり、その詳細をデリバティブ取引に関する注記及び附属明細表に記載しております。</p> <p>これらの金融商品に係るリスクは、市場リスク（価格変動、為替変動等）、信用リスク、流動性リスクであります。</p> <p>外貨建資産の売買代金等の受取りまたは支払いを目的として、投資信託約款に従って為替予約取引を利用しております。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>複数の部署と会議体が連携する組織的な体制によりリスク管理を行っております。信託財産全体としてのリスク管理を金融商品、リスクの種類毎に行っております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては、一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等に拠った場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成31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	<p>金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 金融商品の時価の算定方法	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 デリバティブ取引に関する注記に記載しております。</p> <p>(3)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成30年7月17日現在	平成31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	5,496,529,888	2,958,347,337
合計	5,496,529,888	2,958,347,337

(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30年3月16日から平成30年7月17日まで、及び平成30年9月19日から平成31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30年7月17日 現在				平成31年1月15日 現在			
	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等		時価 (円)	評価損益 (円)
	(円)	うち 1年超			(円)	うち 1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売 建	344,998,471	-	344,404,357	594,114	993,859,756	-	993,623,697	236,059
アメリカ・ドル	236,977,832	-	236,396,806	581,026	390,884,756	-	390,848,697	36,059
オーストラリア・ドル	-	-	-	-	195,300,000	-	195,275,000	25,000
シンガポール・ドル	108,020,639	-	108,007,551	13,088	200,375,000	-	200,350,000	25,000
香港・ドル	-	-	-	-	207,300,000	-	207,150,000	150,000
買 建	119,558,471	-	119,181,876	376,595	993,859,756	-	993,947,232	87,476
アメリカ・ドル	108,020,639	-	107,656,556	364,083	602,975,000	-	602,854,840	120,160
オーストラリア・ドル	11,537,832	-	11,525,320	12,512	-	-	-	-
ユーロ	-	-	-	-	390,884,756	-	391,092,392	207,636
合計	464,556,942	-	463,586,233	217,519	1,987,719,512	-	1,987,570,929	323,535

(注) 1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

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

(1口当たり情報)

	平成30年7月17日現在	平成31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)	2,3415円 (23,415円)	2,2156円 (22,156円)

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	アメリカ・ドル			アメリカ・ドル	
		PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	274,673	8,470,915.320	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	46,601	7,956,654.740	
		BOSTON PROPERTIES INC	100,673	11,892,501.490	
		APARTMENT INVT & MGMT CO -A	224,808	10,165,817.760	
		VORNADO REALTY TRUST	124,986	8,001,603.720	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	36,248	6,131,711.680	
		EQUITY RESIDENTIAL	130,264	8,809,754.320	
		EQUINIX INC	22,209	8,363,465.220	
		AMERICAN TOWER CORP	37,250	6,012,150.000	
		FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	288,006	7,491,036.060	
		HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	279,169	8,422,528.730	
		RLJ LODGING TRUST	338,620	5,952,939.600	
		CYRUSONE INC	192,285	9,941,134.500	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	174,847	6,037,466.910			

	PARK HOTELS & RESORTS INC	229,171	6,474,080.750	
	INVITATION HOMES INC	672,253	13,713,961.200	
	VICI PROPERTIES INC	511,663	10,463,508.350	
	LIFE STORAGE INC	86,581	7,926,490.550	
	VENTAS INC	66,372	3,987,629.760	
	CROWN CASTLE INTL CORP	55,901	5,948,984.420	
	IRON MOUNTAIN INC	190,759	6,632,690.430	
	VEREIT INC	1,360,196	10,310,285.680	
	SUN COMMUNITIES INC	171,068	17,662,771.000	
	PROLOGIS INC	391,667	24,420,437.450	
	COUSINS PROPERTIES INC	502,571	4,201,493.560	
	SITE CENTERS CORP	442,920	5,447,916.000	
	DUKE REALTY CORP	369,171	10,159,585.920	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	87,045	21,664,630.050	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	49,308	6,064,884.000	
	WELLTOWER INC	341,535	24,307,045.950	
	HCP INC	416,371	12,062,267.870	
	KILROY REALTY CORP	187,141	12,536,575.590	
	MACERICH CO/THE	88,066	3,968,253.960	
	REALTY INCOME CORP	99,663	6,361,489.290	
	REGENCY CENTERS CORP	161,293	9,650,160.190	
	UDR INC	650,299	26,089,995.880	
	CUBESMART	223,093	6,418,385.610	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	395,567	5,522,115.320	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	134,176	14,291,085.760	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	135,761	12,222,562.830	
	DOUGLAS EMMETT INC	174,170	6,106,400.200	
	アメリカ・ドル 小計		アメリカ・ドル 408,265,367.620 (44,255,965,849)	
	イギリス・ポンド		イギリス・ポンド	
	ASSURA PLC	14,484,145	7,937,311.460	
	SEGRO PLC	2,543,075	15,772,151.150	
	UNITE GROUP PLC	339,396	2,891,653.920	
	BRITISH LAND CO PLC	2,592,295	14,242,068.730	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	1,128,858	6,039,390.300	
	BIG YELLOW GROUP PLC	643,408	5,777,803.840	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	4,088,213	7,277,019.140	

イギリス・ポンド 小計			イギリス・ポンド 59,937,398.540 (8,370,857,080)
オーストラリア・ドル	NATIONAL STORAGE REIT	12,579,703	オーストラリア・ドル 22,328,972.820
	SCENTRE GROUP	2,860,758	11,671,892.640
	GPT GROUP	7,733,315	42,455,899.350
	GOODMAN GROUP	1,845,608	20,873,826.480
	CHARTER HALL GROUP	2,934,087	22,005,652.500
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	6,011,756	17,674,562.640
	オーストラリア・ドル 小計		
カナダ・ドル	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	397,407	カナダ・ドル 15,498,873.000
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	403,368	18,401,648.160
カナダ・ドル 小計			カナダ・ドル 33,900,521.160 (2,769,333,574)
シンガポール・ドル	KEPPEL DC REIT	15,119,513	シンガポール・ドル 21,016,123.070
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	1,931,700	5,176,956.000
	PARKWAYLIFE REAL ESTATE	6,252,477	16,944,212.670
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	3,027,100	5,963,387.000
シンガポール・ドル 小計			シンガポール・ドル 49,100,678.740 (3,935,419,401)
ユーロ	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	652,915	ユーロ 8,331,195.400
	GECINA SA	117,678	14,003,682.000
	KLEPIERRE	616,822	17,252,511.340
	COVIVIO	200,241	17,270,786.250
	AEDIFICA	48,652	3,833,777.600
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	37,259	4,411,465.600
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	1,751,060	15,050,360.700
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	886,052	9,773,153.560
ユーロ 小計			ユーロ 89,926,932.450

			(11,186,011,128)
香港・ドル			香港・ドル
	FORTUNE REIT	12,880,070	121,587,860.800
	LINK REIT	3,962,305	316,588,169.500
香港・ドル 小計			香港・ドル 438,176,030.300 (6,055,592,739)
投資証券 合計			87,276,463,970 [87,276,463,970]
合計			87,276,463,970 [87,276,463,970]

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%	50.7%
イギリス・ポンド	投資証券 7銘柄	100%	9.6%
オーストラリア・ドル	投資証券 6銘柄	100%	12.3%
カナダ・ドル	投資証券 2銘柄	100%	3.2%
シンガポール・ドル	投資証券 4銘柄	100%	4.5%
ユーロ	投資証券 8銘柄	100%	12.8%
香港・ドル	投資証券 2銘柄	100%	6.9%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

「ダイワ」-REITアクティブ・マザーファンド」の状況

以下に記載した情報は監査の対象外であります。

貸借対照表

	平成30年7月17日現在	平成31年1月15日現在
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
金銭信託	142,081,289	7,145,216
コール・ローン	450,942,351	88,327,630
投資証券	101,725,503,300	101,956,404,620
未収入金	258,233,953	869,536,168
未収配当金	775,432,994	1,022,947,360
流動資産合計	103,352,193,887	103,944,360,994
資産合計	103,352,193,887	103,944,360,994
負債の部		
流動負債		
未払金	212,604,279	80,294,000
未払解約金	3,992,000	8,929,000
その他未払費用	5,731	5,352
流動負債合計	216,602,010	89,228,352
負債合計	216,602,010	89,228,352
純資産の部		
元本等		
元本	1 40,796,237,478	40,057,484,890
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	62,339,354,399	63,797,647,752
元本等合計	103,135,591,877	103,855,132,642
純資産合計	103,135,591,877	103,855,132,642
負債純資産合計	103,352,193,887	103,944,360,994

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成30年7月18日 至 平成31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

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

(貸借対照表に関する注記)

区 分	平成30年7月17日現在	平成31年1月15日現在
1. 1 期首	平成30年1月16日	平成30年7月18日
期首元本額	39,926,017,275円	40,796,237,478円
期中追加設定元本額	2,376,981,019円	1,334,294,367円
期中一部解約元本額	1,506,760,816円	2,073,046,955円

成果リレー(ブラジル国債 & J-REIT)2014-08	28,519,083円	- 円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース)	199,467,823円	209,009,628円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース)	271,136,277円	277,551,866円
DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース)	342,638,865円	352,603,357円
DCダイワJ-REITアクティブファンド	357,277,561円	354,082,358円
ダイワファンドラップ J-REITセレクト	37,806,104,594円	37,237,241,667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)	119,731,190円	98,597,464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)	39,146,465円	33,674,499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)	185,546,506円	162,026,929円
ダイワ・アクティブJリート・ファンド(年4回決算型)	705,989,018円	689,566,564円
計	40,796,237,478円	40,057,484,890円
2. 期末日における受益権の総数	40,796,237,478口	40,057,484,890口

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

区分	自 平成30年7月18日 至 平成31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31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	<p>(1)有価証券 重要な会計方針に係る事項に関する注記に記載しております。</p> <p>(2)コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	平成30年7月17日現在	平成31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	2,373,735,467	139,108,254
合計	2,373,735,467	139,108,254

（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30年5月11日から平成30年7月17日まで、及び平成30年11月13日から平成31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30年7月17日現在	平成31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30年7月17日現在	平成31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）	2,5281円 （25,281円）	2,5927円 （25,927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	1,667	900,180,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	16,955	1,490,344,500	
	森ヒルズリート	22,201	3,037,096,800	
	産業ファンド	9,639	1,108,485,000	
	アドバンス・レジデンス	9,965	3,119,045,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	11,163	1,879,849,200	
	A P I 投資法人	5,240	2,276,780,000	
	G L P 投資法人	18,573	2,030,028,900	
	コンフォリア・レジデンシャル	3,452	970,012,000	
	日本プロロジスリート	18,781	4,313,995,700	
	星野リゾート・リート	4,123	2,135,714,000	
	O N E リート投資法人	2,716	741,468,000	
	イオンリート投資	6,054	767,041,800	
	ヒューリックリート投資法	15,524	2,629,765,600	
	日本リート投資法人	6,151	2,272,794,500	
	インベスコ・オフィス・Jリート	33,556	524,144,720	
	日本ヘルスケア投資法	432	72,748,800	
	積水ハウス・リート投資	42,998	3,117,355,000	
	ケネディクス商業リート	8,173	2,080,028,500	
	ヘルスケア&メディカル投資	1,801	207,115,000	
	野村不動産マスターF	43,847	6,506,894,800	
	ラサールロジポート投資	10,475	1,105,112,500	
	三井不ロジパーク	4,708	1,513,622,000	
大江戸温泉リート	9,339	755,525,100		
投資法人みらい	2,448	460,224,000		

森トラスト・ホテルリート投	5,064	655,788,000	
三菱地所物流REIT	2,329	567,111,500	
CREロジスティクスファンド	5,361	545,749,800	
ザイマックス・リート	9,071	1,030,465,600	
日本ビルファンド	7,309	5,101,682,000	
ジャパンリアルエステイト	16,289	10,164,336,000	
日本リテールファンド	20,028	4,374,115,200	
オリックス不動産投資	27,144	4,972,780,800	
日本プライムリアルティ	3,892	1,657,992,000	
プレミア投資法人	12,042	1,492,003,800	
グローバル・ワン不動産投資法人	2,446	298,412,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	16,967	2,867,423,000	
森トラスト総合リート	12,844	2,088,434,400	
インヴィンシブル投資法人	39,462	1,854,714,000	
フロンティア不動産投資	5,264	2,258,256,000	
福岡リート投資法人	6,712	1,118,890,400	
ケネディクス・オフィス投資法人	5,012	3,593,604,000	
いちごオフィスリート投資法人	1,298	125,906,000	
大和証券オフィス投資法人	2,580	1,787,940,000	
阪急阪神リート投資法人	1,353	192,802,500	
スターツプロシード投資法人	4,455	752,449,500	
大和ハウスリート投資法人	15,544	3,830,041,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	27,498	2,114,596,200	
日本賃貸住宅投資法人	16,590	1,381,947,000	
ジャパンエクセレント投資法人	7,419	1,113,591,900	
投資証券 合計		101,956,404,620	
合計		101,956,404,620	

投資証券における券面総額欄の数値は、証券数を表示しております。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2019年1月31日

資産総額	99,038,495円
負債総額	46,710円
純資産総額（ - ）	98,991,785円
発行済数量	105,270,093口
1 単位当たり純資産額（ / ）	0.9404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

2019年1月31日

資産総額	46,583,435円
負債総額	74,264円
純資産総額（ - ）	46,509,171円
発行済数量	40,946,006口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.1359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

2019年1月31日

資産総額	704,204,181円
負債総額	3,548,669円
純資産総額（ - ）	700,655,512円
発行済数量	342,879,794口
1 単位当たり純資産額（ / ）	2.0434円

(参考) ダイワ・外債ソブリン・マザーファンド

純資産額計算書

2019年1月31日

資産総額	28,034,355,248円
負債総額	50,687,385円
純資産総額（ - ）	27,983,667,863円
発行済数量	16,869,672,984口
1単位当たり純資産額（ / ）	1.6588円

(参考) ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド

純資産額計算書

2019年1月31日

資産総額	96,893,576,128円
負債総額	1,183,883,794円
純資産総額（ - ）	95,709,692,334円
発行済数量	40,430,063,462口
1単位当たり純資産額（ / ）	2.3673円

(参考) ダイワJ-REITアクティブ・マザーファンド

純資産額計算書

2019年1月31日

資産総額	108,369,147,686円
負債総額	309,121,818円
純資産総額（ - ）	108,060,025,868円
発行済数量	40,079,236,360口

1 単位当たり純資産額 (/)

2.6962円

第4 【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 名義書換えの手続き等
該当事項はありません。

(2) 受益者に対する特典
ありません。

(3) 譲渡制限の内容
譲渡制限はありません。

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

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

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

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

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

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

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

(9) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部 【委託会社等の情報】

第1 【委託会社等の概況】

1 【委託会社等の概況】

a. 資本金の額

2019年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。

2019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	164,657
追加型株式投資信託	715	14,961,679
株式投資信託 合計	795	15,126,336
単位型公社債投資信託	30	114,211
追加型公社債投資信託	14	1,402,192
公社債投資信託 合計	44	1,516,404
総合計	839	16,642,740

3 【委託会社等の経理状況】

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

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59期事業年度（平成29年4月1日から平成30年3月31日まで）の財務諸表についての監査を、有限責任 あずさ監査法人により受けております。

また、第60期事業年度に係る中間会計期間（2018年4月1日から2018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29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	31,260	28,709
有価証券	110	0
前払費用	190	201
未収委託者報酬	10,453	12,368
未収収益	72	82
繰延税金資産	439	552
その他	34	47
流動資産計	42,560	41,962
固定資産		
有形固定資産	1 229	1 213
建物	15	12
器具備品	214	200
無形固定資産	2,650	2,614
ソフトウェア	2,323	2,456
ソフトウェア仮勘定	327	158
投資その他の資産	12,353	15,066

投資有価証券	5,920	8,600
関係会社株式	5,129	5,129
出資金	185	183
長期差入保証金	1,050	1,072
繰延税金資産	31	45
その他	37	34
固定資産計	15,234	17,894
資産合計	57,795	59,856

(単位:百万円)

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

資本剰余金合計	11,495	11,495
利益剰余金		
利益準備金	374	374
その他利益剰余金		
繰越利益剰余金	12,231	13,370
利益剰余金合計	12,606	13,744
株主資本合計	39,276	40,414
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	264	216
評価・換算差額等合計	264	216
純資産合計	39,540	40,631
負債・純資産合計	57,795	59,856

(2) 【損益計算書】

(単位:百万円)

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

賞与	531	477
賞与引当金繰入額	945	1,012
福利厚生費	807	788
交際費	60	55
旅費交通費	178	195
租税公課	531	501
不動産賃借料	1,273	1,281
退職給付費用	463	316
役員退職慰労引当金繰入額	60	46
固定資産減価償却費	1,045	977
諸経費	1,400	1,528
一般管理費計	11,655	11,531
営業利益	16,554	18,411

(単位:百万円)

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：百万円）

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

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：百万円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		株主資本合計
		資本準備金	利益準備金	その他利益 剰余金	利益剰余金 合計	
				繰越利益 剰余金		
当期首残高	15,174	11,495	374	12,231	12,606	39,276
当期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	11,532	11,532	11,532
当期純利益	-	-	-	12,670	12,670	12,670
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）	-	-	-	-	-	-
当期変動額合計	-	-	-	1,138	1,138	1,138
当期末残高	15,174	11,495	374	13,370	13,744	40,414

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

注記事項

（重要な会計方針）

1．有価証券の評価基準及び評価方法

（1）子会社株式

移動平均法による原価法により計上しております。

（2）その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2．固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下の通りであります。

建物	10～18年
器具備品	4～20年

(2) 無形固定資産

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

3．引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

(3) 役員退職慰労引当金

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

4．消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

5．連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

(損益計算書)

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

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

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

2 関係会社項目

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

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

3 保証債務

前事業年度(平成29年3月31日)

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

当事業年度(平成30年3月31日)

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)

1 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

当事業年度(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

(単位:千株)

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

証券投資信託に係る運用報酬の未決済額である未収委託者報酬は、運用するファンドの財産が信託されており、「投資信託及び投資法人に関する法律」、その他関係法令等により一定の制限が設

けられているためリスクは極めて軽微であります。有価証券及び投資有価証券は、証券投資信託、株式であります。証券投資信託は事業推進目的で保有しており、価格変動リスク及び為替変動リスクに晒されており、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、

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

（3）金融商品に係るリスク管理体制

市場リスクの管理

（ ）為替変動リスクの管理

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

（ ）価格変動リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：百万円）

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

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

当事業年度（平成30年3月31日）

(単位:百万円)

	貸借対照表 計上額(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	28,709	28,709	-
(2) 未収委託者報酬	12,368	12,368	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 其他有価証券	7,631	7,631	-
資産計	48,709	48,709	-
(1) 未払手数料	(5,202)	(5,202)	-
(2) その他未払金	(4,476)	(4,476)	-
(3) 未払費用(*2)	(3,286)	(3,286)	-
負債計	(12,965)	(12,965)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資 産

(1) 現金・預金、並びに(2) 未収委託者報酬

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

(3) 有価証券及び投資有価証券

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

負 債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金、並びに(3) 未払費用

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:百万円)

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成29年3月31日)

(単位:百万円)

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

当事業年度(平成30年3月31日)

(単位:百万円)

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

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度(平成29年3月31日)

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

当事業年度(平成30年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度(平成29年3月31日)

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

小計	1,829	1,926	96
合計	5,060	4,679	381

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

当事業年度(平成30年3月31日)

	貸借対照表計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
(1) 株式	134	55	79
(2) その他 証券投資信託	4,196	3,740	456
小計	4,331	3,795	535
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他 証券投資信託	3,299	3,522	223
小計	3,299	3,522	223
合計	7,631	7,318	312

(注) 非上場株式(貸借対照表計上額 970百万円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「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28年4月1日 至 平成29年3月31日)

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

4. 減損処理を行った有価証券

前事業年度において、該当事項はありません。

当事業年度において、該当事項はありません。

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)	(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)
勤務費用	202百万円	159百万円

その他	87	24
確定給付制度に係る退職給付費用	289	184

3. 確定拠出制度

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

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別内訳

（単位：百万円）

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

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

前事業年度（平成29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

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

[関連情報]

1. サービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

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

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

(ア) 財務諸表提出会社の子会社

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)	科目	期末残高(百万円)
子会社	Daiwa Asset Management (Singapore) Ltd.	Singapore	133	金融商品取引業	(所有)直接100.0	経営管理	債務保証(注)	1,701	-	-

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(イ) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金または出資金(百万円)	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合(%)	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(百万円)(注1)	科目	期末残高(百万円)
同一の親会社をもつ会社	大和証券(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。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

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

2.親会社に関する注記

株式会社大和証券グループ本社(東京証券取引所、名古屋証券取引所に上場)

(1株当たり情報)

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

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

(注2)1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下の通りであります。

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

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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 (2018年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金		21,097
有価証券		0
未収委託者報酬		12,445
その他		2,329
流動資産合計		35,872
固定資産		
有形固定資産	1	199
無形固定資産		
ソフトウェア		2,162
その他		449
無形固定資産合計		2,612
投資その他の資産		
投資有価証券		7,521
関係会社株式		1,836
繰延税金資産		964
その他		1,286
投資その他の資産合計		11,608
固定資産合計		14,420
資産合計		50,293

(単位:百万円)

		当中間会計期間 (2018年9月30日)
負債の部		
流動負債		
未払金		7,165
未払費用		3,666

未払法人税等	859
賞与引当金	611
その他	2
流動負債合計	12,855
固定負債	
退職給付引当金	2,335
役員退職慰労引当金	144
その他	3
固定負債合計	2,483
負債合計	15,338
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	7,643
利益剰余金合計	8,017
株主資本合計	34,687
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	267
評価・換算差額等合計	267
純資産合計	34,955
負債・純資産合計	50,293

(2) 中間損益計算書

(単位:百万円)

	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	39,713
その他営業収益	351
営業収益合計	40,065
営業費用	
支払手数料	18,868
その他営業費用	6,357

営業費用合計		25,226
一般管理費	1	5,925
営業利益		8,913
営業外収益	2	418
営業外費用	3	86
経常利益		9,244
特別利益		-
特別損失	4	29
税引前中間純利益		9,215
法人税、住民税及び事業税		2,628
法人税等調整額		125
中間純利益		6,462

(3) 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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	13,370	13,744	40,414
会計方針の変更による累積的影響額				480	480	480
会計方針の変更を反映した当期首残高	15,174	11,495	374	13,850	14,225	40,895
当中間期変動額						
剰余金の配当	-	-	-	12,669	12,669	12,669
中間純利益	-	-	-	6,462	6,462	6,462
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	-	-	-	6,207	6,207	6,207
当中間期末残高	15,174	11,495	374	7,643	8,017	34,687

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	216	216	40,631
会計方針の変更による累積的影響額			480
会計方針の変更を反映した当期首残高			41,112
当中間期変動額			
剰余金の配当	-	-	12,669
中間純利益	-	-	6,462
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	50	50	50
当中間期変動額合計	50	50	6,156
当中間期末残高	267	267	34,955

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) その他有価証券

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。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。

(会計方針の変更)

(税効果会計に係る会計基準の適用指針の適用)

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

(表示方法の変更)

(『税効果会計に係る会計基準』の一部改正の適用)

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

(中間貸借対照表関係)

1 減価償却累計額

当中間会計期間

(2018年9月30日現在)

有形固定資産	280百万円
--------	--------

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(2018年9月30日現在)

子会社であるDaiwa Asset Management(Singapore)Ltd.の債務1,743百万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 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
有形固定資産	16百万円
無形固定資産	436百万円

2 営業外収益の主要項目

	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
有価証券償還益	132百万円
投資有価証券売却益	124百万円
為替差益	104百万円

3 営業外費用の主要項目

	当中間会計期間 (自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)
有価証券償還損	32百万円
投資有価証券売却損	24百万円
固定資産除却損	13百万円

4 特別損失の主要項目

当中間会計期間

(自 2018年4月1日
至 2018年9月30日)

関係会社整理損失

29百万円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018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
2018年6月25日 定時株主総会	普通株式	12,669	4,857	2018年3月31日	2018年6月26日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2018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(*1)	時価(*1)	差額
(1) 現金・預金	21,097	21,097	-
(2) 未収委託者報酬	12,445	12,445	-
(3) 有価証券及び投資有価証券 その他有価証券	6,551	6,551	-
資産合計	40,094	40,094	-
(1) 未払金	(7,096)	(7,096)	-
(2) 未払費用(*2)	(3,089)	(3,089)	-
負債合計	(10,186)	(10,186)	-

(*1) 負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

（注1）金融商品の時価の算定方法

資 産

（1）現金・預金及び（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	1,836
差入保証金	1,071

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（2018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 1,836百万円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2．その他有価証券

	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	129	55	74
（2）その他			

証券投資信託	4,148	3,765	383
小計	4,277	3,820	457
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	2,274	2,378	104
小計	2,274	2,378	104
合計	6,551	6,198	352

(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 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018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 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
1株当たり純資産額	13,400.41円
1株当たり中間純利益	2,477.30円

(注1) 潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、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 2018年4月1日 至 2018年9月30日)	
中間純利益(百万円)	6,462
普通株式に係る中間純利益(百万円)	6,462
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】

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

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

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

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

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

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

5 【その他】

a. 定款の変更、事業譲渡または事業譲受、出資の状況その他の重要事項

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

b. 訴訟事件その他委託会社に重要な影響を及ぼすことが予想される事実

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

第2 【その他の関係法人の概況】

1 【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

名称 三井住友信託銀行株式会社

資本金の額 342,037百万円（2018年3月末日現在）

事業の内容

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

(2) 販売会社

名称 株式会社滋賀銀行

資本金の額 33,076百万円（2018年3月末日現在）

事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。

<参考> 「ダイワ・グローバルREIT・マザーファンド」の投資顧問会社

名称 コーヘン&スティアーズ・キャピタル・マネジメント・インク

資本金の額 511千米ドル（約57百万円）（2017年12月末日現在）

事業の内容 資産運用業務を行なっています。

2 【関係業務の概要】

受託会社は、信託契約の受託者であり、委託会社の指図に基づく信託財産の管理・処分、信託財産の計算等を行ないます。なお、外国における資産の保管は、その業務を行なうに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行なう場合があります。

販売会社は、受益権の募集の取扱い、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金・償還金・一部解約金の支払いに関する事務等を行ないます。

3 【資本関係】

該当事項はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

資本金の額：51,000百万円（2018年3月末日現在）

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

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

第3 【その他】

(1) 目論見書の表紙から本文の前までの記載等について

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

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

委託会社等の情報、受託会社に関する情報を記載することがあります。

詳細な情報の入手方法として、以下の事項を記載することがあります。

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

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

- ・届出をした日及び当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
- ・届出をした日、届出が効力を生じている旨及び効力発生日
次の事項を記載することがあります。
- ・投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
- ・請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨及び当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
- ・「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載

委託会社、当ファンドのロゴ・マーク等を記載することがあります。

ファンドの形態等を記載することがあります。

図案を採用することがあります。

ファンドの管理番号等を記載することがあります。

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

UD FONT マークおよび説明文を記載することがあります。

(2) 当ファンドは、評価機関等の評価を取得、使用する場合があります。

(3) 交付目論見書に最新の運用実績を記載することがあります。

(4) 請求目論見書に当ファンドの投資信託約款の全文を記載します。

独立監査人の監査報告書

平成30年 5月25日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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

(注)2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成31年2月15日

大和証券投資信託委託株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている『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7月18日から平成31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31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。

独立監査人の中間監査報告書

2018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	小倉 加奈子 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	間瀬 友未 印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	深井 康治 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている大和証券投資信託委託株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018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に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2018年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2018年4月1日から2018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。